

**POPIS DATOVÉHO SOUBORU**

Kód: SISIFE13

Akronym: VUS (ČNB) 13-12

Název: Měs. výkaz o úrok.sazbách neob.dluh.CP v nových obchodech

**Charakteristika:**

Přehled objemů bankou emitovaných neobchodovatelných dluhových cenných papírů prodaných v nových obchodech sjednaných mezi bankou a rezidenty ČR (jinými než finanční a vládní instituce) v průběhu sledovaného měsíce v členění podle propočtené úrokové sazby (tzv. anualizované sjednané sazby, případně úzce definované efektivní úrokové sazby), sektorů držitelů, vybraných měn, typu cenného papíru a původně stanovené splatnosti při emisi a přehled objemů bankou nově v primárních emisích nakoupených neobchodovatelných dluhových cenných papírů emitovaných nebankovními subjekty - rezidenty ČR (bez finančních a vládních institucí) v průběhu sledovaného měsíce v členění dle propočtené úrokové sazby (tzv. anualizované sjednané sazby, případně úzce definované efektivní úrokové sazby), sektorů emitentů, vybraných měn, typů cenných papírů a původně stanovené splatnosti při emisi.

**Části datového souboru:**

Část: 1 - Úrokové sazby emitovaných neobch.cen.papírů

**Přiřazené datové oblasti:**

Pořadí	Kód	Název
1	SIS13_01	Úrokové sazby z nových obchodů - emit. neobchod. cen. papíry

Část: 2 - Úrokové sazby nakoupených neobch.cen.papírů

**Přiřazené datové oblasti:**

Pořadí	Kód	Název
1	SIS13_02	Úrokové sazby z nových obchodů - nakoup. neobch. cen. papíry

Výkaz.povinnost: VP\_SISIFE13\_1 1012 10-MAY-05 18-FEB-05

Název : Výkazovací povinnost pro SISIFE13

**Výčet a konkretizace výskytových parametrů datového souboru:**

Kód	Název parametru	O	Hodnota	Název hodnoty
P0002	Vykazující subjekt - banka, nebankovní subjekt	E	ZKOMBAN	Banky a pobočky zahraničních bank působící v ČR bez ČNB
P0046	Rozsah vykazování podle území	E	ZCR	Údaje za Českou republiku
P0053	Stav ke dni	E	d1_I1	Datum ve tvaru YYYYMMDD z přípustného intervalu

**Výčet a konkretizace organizačních parametrů datového souboru:**

Kód	Název parametru	O	Hodnota	Název hodnoty
P0012	Periodicita	=	12	Měsíční
P0060	Termín předkládání	=	M_1_12_12	Do 22. následujícího měsíce

**Poznámka:**

Verze: 3.1	Stav: Platný	Platnost od: 01.01.2006
Zdroj: ČNB		
Garant věcného obsahu : Gregorová/odb.416		
Garant metodického popisu: Nováková/odb.416		

**POPIS DATOVÝCH OBLASTÍ PRO DATOVÝ SOUBOR****Datový soubor:** SISIFE13**Akronym:** VUS (ČNB) 13-12**Název:** Měs. výkaz o úrok.sazbách neob.dluh.CP v nových obchodech**Datová oblast:** SIS13 01**Název:** Úrokové sazby z nových obchodů - emit. neobchod. cen. papíry**Charakteristika:**

Objem bankou emitovaných neobchodovatelných dluhových cenných papírů, které byly prodány rezidentům v ČR (jiným než finančním a vládním institucím) v nových obchodech v průběhu sledovaného měsíce v členění dle propočtené úrokové sazby (výše sazby s přesností na 2 desetinná místa), sektorů klientů (nefinanční podniky, domácnosti, neziskové instituce sloužící domácnostem - rezidenti ČR), vybraných měn (CZK, EUR, USD), druhů cenných papírů (depozitní směnky, ostatní směnky, neobchodovatelné dluhopisy) a původní splatnosti stanovené při emisi (hranice pásem: 1 rok, 2 roky, 5 let).

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
EPN0002_001	Emit. neobch. CP - splatnost do 1 roku včetně	
EPN0002_002	Emit. neobch. CP - splatnost nad 1 rok až do 2 let včetně	
EPN0002_003	Emit. neobch. CP - splatnost nad 2 roky až do 5 let včetně	
EPN0002_004	Emit. neobch. CP - splatnost nad 5 let	

**Datový typ údajů v datové oblasti:**

n11 3T - n14 (11čís. znaků + 3 des. místa v násobku tisíc)

**Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0017	Propočtená úroková sazba v procentech	Několik : p3_2_I1	Interval nad DT p3_2
P0019	Struktura sledovaných měn	Několik : D_S_3MENY1	CZK, EUR a USD
P0036	Objekt vykazování podle sektorů ESA95	Několik : D_S_RNPDOM1	Nefinanční podniky, domácnosti a nezisk.inst. sloužící domác.
P0088	Druh cenného papíru	Několik : D_S_NEOBCP1	Neobchodovatelné CP

**Výčet konstantních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0009	Jednotka veličiny	Položka : CZK	Koruna česká
P0011	Časová charakteristika	Položka : 440	Měsíc
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 400	Intervalový údaj
P0186	Ocenění aktiv/pasiv	Položka : 23	Statistická nominální hodnota

Datový soubor: SISIFE13

Akronym: VUS (ČNB) 13-12

Datová oblast: SIS13 01

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Parametry	P0065
<b>Informační prvky</b>	Smluvní doba splatnosti
<b>EPN0002_001</b> Emit. neobch. CP - splatnost do 1 roku včetně	<b>Položka : 18</b> Do 1 roku včetně
<b>EPN0002_002</b> Emit. neobch. CP - splatnost nad 1 rok až do 2 let včetně	<b>Položka : 30</b> Nad 1 rok do 2 let včetně
<b>EPN0002_003</b> Emit. neobch. CP - splatnost nad 2 roky až do 5 let včetně	<b>Položka : 31</b> Nad 2 roky do 5 let včetně
<b>EPN0002_004</b> Emit. neobch. CP - splatnost nad 5 let	<b>Položka : 39</b> Nad 5 let

**Poznámka:**

Propočtená úroková sazba je roční úroková sazba zahrnující tzv. kapitalizaci úroků, t.j. sazba zahrnující vliv četnosti výplat úroků. Může být počítána dvěma způsoby :

- jako "anualizovaná sjednaná sazba" nebo
- jako "úzce definovaná efektivní úroková sazba" (zejména u komplexnějších produktů).

Verze: 3.0  
Zdroj: ČNB

Stav: Platný  
Garant: Hubinka / odb.416  
Platnost od: 31.03.2005

Datový soubor: SISIFE13

Akronym: VUS (ČNB) 13-12

Datová oblast: SIS13 02

Název: Úrokové sazby z nových obchodů - nakoup. neobch. cen. papíry

**Charakteristika:**

Objem neobchodovatelných dluhových cenných papírů emitovaných nebankovními subjekty - rezidenty ČR (bez finančních a vládních institucí) nakoupených bankou v primárních emisích v průběhu sledovaného měsíce v členění dle propočtené úrokové sazby (výše sazby s přesností na 2 desetinná místa), sektorů emitentů (nefinanční podniky, domácnosti, neziskové instituce sloužící domácnostem - rezidenti ČR), vybraných měn (CZK, EUR, USD), druhů cenných papírů (depozitní směnky, ostatní směnky, neobchodovatelné dluhopisy) a původní splatnosti stanovené při emisi (hranice pásem: 1 rok, 5 let, 10 let).

**Výčet informačních prvků v datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
EAN0003_001	Nakoup. neobch. CP - splatnost do 1 roku včetně	
EAN0003_002	Nakoup. neobch. CP - splatnost nad 1 rok až do 5 let včetně	
EAN0003_003	Nakoup. neobch. CP - splatnost nad 5 let	

**Datový typ údajů v datové oblasti:**

n11 3T - n14 (11čís. znaků + 3 des. místa v násobku tisíc)

**Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0017	Propočtená úroková sazba v procentech	Několik : p3_2_I1	Interval nad DT p3_2
P0019	Struktura sledovaných měn	Několik : D_S_3MENY1	CZK, EUR a USD
P0036	Objekt vykazování podle sektorů ESA95	Několik : D_S_RNPD0M1	Nefinanční podniky, domácnosti a nezisk.inst. sloužící domác.
P0088	Druh cenného papíru	Několik : D_S_NEOBCP1	Neobchodovatelné CP

**Výčet konstantních parametrů datové oblasti:**

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0009	Jednotka veličiny	Položka : CZK	Koruna česká
P0011	Časová charakteristika	Položka : 440	Měsíc
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 400	Intervalový údaj
P0186	Ocenění aktiv/pasiv	Položka : 23	Statistická nominální hodnota

Datový soubor: SISIFE13

Akronym: VUS (ČNB) 13-12

Datová oblast: SIS13 02

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Parametry	P0065
<b>Informační prvky</b>	Smluvní doba splatnosti
<b>EAN0003_001</b> Nakoup. neobch. CP - splatnost do 1 roku včetně	<b>Položka : 18</b> Do 1 roku včetně
<b>EAN0003_002</b> Nakoup. neobch. CP - splatnost nad 1 rok až do 5 let včetně	<b>Položka : 62</b> Nad 1 rok do 5 let včetně
<b>EAN0003_003</b> Nakoup. neobch. CP - splatnost nad 5 let	<b>Položka : 39</b> Nad 5 let

**Poznámka:**

Propočtená úroková sazba je roční úroková sazba zahrnující tzv. kapitalizaci úroků, t.j. sazba zahrnující vliv četnosti výplat úroků. Může být počítána dvěma způsoby :

- jako "anualizovaná sjednaná sazba" nebo
- jako "úzce definovaná efektivní úroková sazba" (zejména u komplexnějších produktů).

**Verze:** 3.0  
**Zdroj:** ČNB

**Stav:** Platný  
**Garant:** Hubinka / odb.416  
**Platnost od:** 31.03.2005

**POPIS JEDNOVÝKAZOVÝCH KONTROL PRO DATOVÝ SOUBOR**

**Kód DS:** SISIFE13

**Akronym:** VUS (ČNB) 13-12

**Krok kontroly:** 10

**Druh:** err

**Název:**

Pro:EPN0002\_001 a typ cenného papíru S\_NEODLCP=null

**Charakteristika:**

**Semantický tvar:**

PRO P0017:Mp3\_2\_I1, P0019:MD\_S\_3MENY1, P0036:MD\_S\_RNPDOM1, P0088.S\_NEODLCP,  
P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0014.400, P0186.23;  
EPN0002\_001 = NULL ;

**Uživatelský tvar:**

PRO

P0017:Mp3\_2\_I1,P0019:MD\_S\_3MENY1,P0036:MD\_S\_RNPDOM1,P0088.S\_NEODLCP;SIS13\_01(N2,  
5=NULL);

**Poznámka:**

**Krok kontroly:** 20

**Druh:** err

**Název:**

Pro:EAN0003\_001 a typ cenného papíru S\_NEODLCP=null

**Charakteristika:**

**Semantický tvar:**

PRO P0017:Mp3\_2\_I1, P0019:MD\_S\_3MENY1, P0036:MD\_S\_RNPDOM1, P0088.S\_NEODLCP,  
P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0014.400, P0186.23;  
EAN0003\_001 = NULL ;

**Uživatelský tvar:**

PRO

P0017:Mp3\_2\_I1,P0019:MD\_S\_3MENY1,P0036:MD\_S\_RNPDOM1,P0088.S\_NEODLCP;SIS13\_02(N2,  
5=NULL);

**Poznámka:**

**Krok kontroly:** 1010

**Druh:** err

**Název:**

EPN0002\_001-Emit. neobch. CP - splatnost do 1 roku  
včetně(S\_3MENY,S\_RNPDOM,p3\_2\_I1,S\_NEOBCEP) = součet elementárních údajů;

**Charakteristika:**

**Semantický tvar:**

PRO P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0014.400, P0186.23;  
SUM EPN0002\_001(P0019:MD\_S\_3MENY1, P0036:MD\_S\_RNPDOM1, P0017:Mp3\_2\_I1,  
P0088:MD\_S\_NEOBCEP1)=  
EPN0002\_001(P0019.S\_3MENY, P0036.S\_RNPDOM, P0017:Sp3\_2\_I1, P0088.S\_NEOBCEP) ODCH  
5000;

**Uživatelský tvar:**

SIS13\_01(SUM N2,5=N1,5 ODCH 5000);

**Poznámka:**

**Krok kontroly:** 1020

**Druh:** err

**Název:**

EPN0002\_002-Emit. neobch. CP - splatnost nad 1 rok až do 2 let  
včetně(S\_3MENY,S\_RNPDOM,p3\_2\_I1,S\_NEOBCEP) = součet elementárních údajů;

**Charakteristika:**

**Semantický tvar:**

PRO P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0014.400, P0186.23;  
SUM EPN0002\_002(P0019:MD\_S\_3MENY1, P0036:MD\_S\_RNPDOM1, P0017:Mp3\_2\_I1,

**Popis JVK**

**Strana:** 1/3

Kód DS: SISIFE13

Akronym: VUS (ČNB) 13-12

**Krok kontroly:** 1020

**Druh:** err

**Semantický tvar:**

P0088:MD\_S\_NEOBCP1)=

EPN0002\_002(P0019.S\_3MENY, P0036.S\_RNPDOM, P0017:Sp3\_2\_I1, P0088.S\_NEOBCP) ODCH 5000;

**Uživatelský tvar:**

SIS13\_01(SUM N2,6=N1,6 ODCH 5000);

**Poznámka:**

**Krok kontroly:** 1030

**Druh:** err

**Název:**

EPN0002\_003-Emit. neobch. CP - splatnost nad 2 roky až do 5 let včetně(S\_3MENY,S\_RNPDOM,p3\_2\_I1,S\_NEOBCP) = součet elementárních údajů;

**Charakteristika:**

**Semantický tvar:**

PRO P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0014.400, P0186.23;

SUM EPN0002\_003(P0019:MD\_S\_3MENY1, P0036:MD\_S\_RNPDOM1, P0017:Mp3\_2\_I1,

P0088:MD\_S\_NEOBCP1)=

EPN0002\_003(P0019.S\_3MENY, P0036.S\_RNPDOM, P0017:Sp3\_2\_I1, P0088.S\_NEOBCP) ODCH 5000;

**Uživatelský tvar:**

SIS13\_01(SUM N2,7=N1,7 ODCH 5000);

**Poznámka:**

**Krok kontroly:** 1040

**Druh:** err

**Název:**

EPN0002\_004-Emit. neobch. CP - splatnost nad 5 let(S\_3MENY,S\_RNPDOM,p3\_2\_I1,S\_NEOBCP) = součet elementárních údajů;

**Charakteristika:**

**Semantický tvar:**

PRO P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0014.400, P0186.23;

SUM EPN0002\_004(P0019:MD\_S\_3MENY1, P0036:MD\_S\_RNPDOM1, P0017:Mp3\_2\_I1,

P0088:MD\_S\_NEOBCP1)=

EPN0002\_004(P0019.S\_3MENY, P0036.S\_RNPDOM, P0017:Sp3\_2\_I1, P0088.S\_NEOBCP) ODCH 5000;

**Uživatelský tvar:**

SIS13\_01(SUM N2,8=N1,8 ODCH 5000);

**Poznámka:**

**Krok kontroly:** 1050

**Druh:** err

**Název:**

EAN0003\_001-Nakoup. neobch. CP - splatnost do 1 roku včetně(S\_3MENY,S\_RNPDOM,p3\_2\_I1,S\_NEOBCP) = součet elementárních údajů;

**Charakteristika:**

**Semantický tvar:**

PRO P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0014.400, P0186.23;

SUM EAN0003\_001(P0019:MD\_S\_3MENY1, P0036:MD\_S\_RNPDOM1, P0017:Mp3\_2\_I1,

P0088:MD\_S\_NEOBCP1)=

EAN0003\_001(P0019.S\_3MENY, P0036.S\_RNPDOM, P0017:Sp3\_2\_I1, P0088.S\_NEOBCP) ODCH 5000;

**Kód DS:** SISIFE13

**Akronym:** VUS (ČNB) 13-12

**Krok kontroly:** 1050

**Druh:** err

**Uživatelský tvar:**

SIS13\_02(SUM N2,5=N1,5 ODCH 5000);

**Poznámka:**

**Krok kontroly:** 1060

**Druh:** err

**Název:**

EAN0003\_002-Nakoup. neobch. CP - splatnost nad 1 rok až do 5 let  
včetně(S\_3MENY,S\_RNPDOM,p3\_2\_I1,S\_NEOBCP) = součet elementárních údajů;

**Charakteristika:**

**Semantický tvar:**

PRO P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0014.400, P0186.23;

SUM EAN0003\_002(P0019:MD\_S\_3MENY1, P0036:MD\_S\_RNPDOM1, P0017:Mp3\_2\_I1,  
P0088:MD\_S\_NEOBCP1)=

EAN0003\_002(P0019.S\_3MENY, P0036.S\_RNPDOM, P0017:Sp3\_2\_I1, P0088.S\_NEOBCP) ODCH  
5000;

**Uživatelský tvar:**

SIS13\_02(SUM N2,6=N1,6 ODCH 5000);

**Poznámka:**

**Krok kontroly:** 1070

**Druh:** err

**Název:**

EAN0003\_003-Nakoup. neobch. CP - splatnost nad 5  
let(S\_3MENY,S\_RNPDOM,p3\_2\_I1,S\_NEOBCP) = součet elementárních údajů;

**Charakteristika:**

**Semantický tvar:**

PRO P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0014.400, P0186.23;

SUM EAN0003\_003(P0019:MD\_S\_3MENY1, P0036:MD\_S\_RNPDOM1, P0017:Mp3\_2\_I1,  
P0088:MD\_S\_NEOBCP1)=

EAN0003\_003(P0019.S\_3MENY, P0036.S\_RNPDOM, P0017:Sp3\_2\_I1, P0088.S\_NEOBCP) ODCH  
5000;

**Uživatelský tvar:**

SIS13\_02(SUM N2,7=N1,7 ODCH 5000);

**Poznámka:**