

POPIS DATOVÉHO SOUBORU**Kód:** DISIFE30**Akronym:** BD (ČNB) 3-12**Název:** Hlášení o angažovanosti banky**Charakteristika:**

Hlášení o angažovanosti investičního a obchodního portfolia povinné osoby vůči osobám (klientům povinné osoby) a ekonomicky spjatým skupinám osob v návaznosti na část pátou, hlava I Vyhlášky ČNB č. xxx (dále jen Vyhláška). Údaje se uvádí v části 2 za všechny dlužníky, u nichž součet angažovanosti investičního portfolia před úpravami a angažovanosti obchodního portfolia činí 10% a více kapitálu relevantního pro výpočet limitů angažovanosti povinné osoby.

Nevykazuje se angažovanost vůči následujícím osobám:

- a) centrálním vládám nebo centrálním bankám, které by nezajištěné obdržely rizikovou váhu 0 % (podle přílohy č. 4 odst. 1 Vyhlášky) při standardizovaném přístupu stanovení kapitálového požadavku k úvěrovému riziku investičního portfolia (dále STA přístup),
- b) mezinárodním organizacím (podle přílohy č. 4 odst. 5 Vyhlášky) nebo mezinárodním rozvojovým bankám (podle přílohy č. 4 odst. 4 Vyhlášky), které by nezajištěné obdržely rizikovou váhu 0 % při STA přístupu,
- c) organizacím veřejného sektoru, pokud by nezajištěné pohledávky za těmito poskytovateli zajištěné obdržely rizikovou váhu 0 % při STA přístupu (podle přílohy č. 4 odst. 3 Vyhlášky).

Pokud povinná osoba zvolí možnost používat dosavadní pravidla angažovanosti (Basel 1) ve vazbě na § 239, odst. 1. a 2.d) Vyhlášky, pak postupuje podle přílohy č. 32, část C Vyhlášky.

Části datového souboru:**Část:** 1 - Celkový kapitál**Přiřazené datové oblasti:**

| Pořadí | Kód | Název |
|--------|----------|---|
| 1 | DIS30_11 | Výše kapitálu relevantního pro limity angažovanosti |

Část: 2 - Angažovanost**Přiřazené datové oblasti:**

| Pořadí | Kód | Název |
|--------|----------|--|
| 1 | DIS30_21 | Angažovanost vůči osobám a ek.spjatým skup.osob |
| 2 | DIS30_22 | Angažovanost jednotl. osob - členů ekonom. spjatých skupin |

Vykaz.povinnost: VP_DISIFE30_1**Název:** Vykazovací povinnost pro DISIFE30**Výčet a konkretizace výskytových parametrů datového souboru:**

| Kód | Název parametru | O | Hodnota | Název hodnoty |
|-------|--|---|---------|---|
| P0002 | Vykazující subjekt - banka, nebankovní subjekt | E | BANCR | Banky se sídlem na území ČR bez ČNB |
| P0046 | Rozsah vykazování podle území | E | ZSVET | Údaje za Českou republiku a zahraničí |
| 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 | = | S_M NV | Měsíčně, jinak na vyžádání |
| P0060 | Termín předkládání | E | ZM_77 | Do 28.násl. měsíce, do 10.2. násl.roku za pros., na vyžádání |

Poznámka:

V části 2 se při uvádění identifikačního čísla nebo data narození osob, vůči nimž je sledována angažovanost, postupuje způsobem uvedeným v popisu parametru P0158.

Kód: DISIFE30

Akronym: BD (ČNB) 3-12

Název: Hlášení o angažovanosti banky

| | | |
|-----------------------------------|---------------------|--------------------------------|
| Verze: 17.1 | Stav: Platný | Platnost od: 02.01.2007 |
| Zdroj: ČNB | | |
| Garant věcného obsahu | :Marcinová/odb.535 | |
| Garant metodického popisu: | Karnet/odb.416 | |

POPIS DATOVÝCH OBLASTÍ PRO DATOVÝ SOUBOR

Datový soubor: DISIFE30

Akronym: BD (ČNB) 3-12

Název: Hlášení o angažovanosti banky

Datová oblast: DIS30_11

Název: Výše kapitálu relevantního pro limity angažovanosti

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje hodnotu kapitálu na individuálním základě povinné osoby relevantní pro výpočet limitů angažovanosti stanovenou podle metodiky k sestavování hlášení o kapitálové přiměřenosti banky BD (ČNB) 2-12 podle části čtvrté, hlava III, díl 1 Vyhlášky ČNB č. xxx.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

| <u>Kód</u> | <u>Název</u> | <u>Datový typ údajů</u> |
|------------|---|-------------------------|
| EBD1693 | Kapitál relevantní pro výpočet limitů angažovanosti | |

Datový typ údajů v datové oblasti:

n11T - n11 (11 číselných znaků v násobku 1 tisíc)

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

Dimenzionální parametry datové oblasti neexistují.

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

| <u>Kód</u> | <u>Název</u> | <u>Operátor : Hodnota</u> | <u>Název hodnoty</u> |
|------------|------------------------|---------------------------|---------------------------------|
| P0011 | Časová charakteristika | Položka : 280 | Poslední den sledovaného období |
| P0014 | Typ ukazatele | Položka : 001 | Okamžikový údaj (stav) |

Datový soubor: DISIFE30

Akronym: BD (ČNB) 3-12

Datová oblast: DIS30_11

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

| Parametry | P0009 | P0019 |
|---|--------------------------------------|---|
| Informační prvky | Jednotka veličiny | Struktura sledovaných měn |
| EBD1693 Kapitál relevantní pro výpočet limitů angažovanosti | Položka : CZK Koruna česká | Položka : S_VSEMEN Všechny měny |

Poznámka :

Verze: 11.0
Zdroj: ČNB

Stav: Platný
Garant: Karnet / odb. 416
Platnost od: 01.01.2007

Datový soubor: DISIFE30

Akronym: BD (ČNB) 3-12

Datová oblast: DIS30_21

Název: Angažovanost vůči osobám a ek.spjatým skup.osob

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje hodnotu angažovanosti investičního portfolia vůči osobám a ekonomicky spjatým skupinám osob před úpravami a po úpravách, poměr hodnoty angažovanosti investičního portfolia po úpravách ke kapitálu relevantnímu pro výpočet limitů angažovanosti, hodnotu angažovanosti obchodního portfolia a angažovanosti obchodního portfolia vypočtenou jako součet zbývajících dlouhých pozic.

Povinná osoba uvádí údaje za všechny dlužníky, u nichž součet angažovanosti investičního portfolia před úpravami a angažovanosti obchodního portfolia činí 10% a více kapitálu na individuálním základě relevantního pro výpočet limitů angažovanosti povinné osoby.

Při vykazování angažovanosti vůči ekonomicky spjatým skupinám se postupuje podle § 2, odst.1, písm.f) Vyhlášky ČNB č.xxx (dále jen Vyhláška).

Limity angažovanosti investičního portfolia jsou vymezeny v § 182 Vyhlášky.

Pro účely angažovanosti se započítává jakákoliv expozice představovaná aktivem v jeho účetní hodnotě před snížením o opravné položky nebo podrozvahovou položkou v účetní hodnotě bez odečtení rezerv vždy bez aplikace rizikových vah nebo konverzních faktorů podle §180 Vyhlášky.

Pokud povinná osoba zvolí možnost používat dosavadní pravidla angažovanosti (Basel 1) ve vazbě na § 239, odst. 1. a 2.d) Vyhlášky, pak postupuje podle přílohy č. 32, část C Vyhlášky.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

| <u>Kód</u> | <u>Název</u> | <u>Datový typ údajů</u> |
|------------|--|-------------------------|
| EBD1100 | Angažovanost investičního portfolia před úpravami | n11 3T |
| EBD1101 | Angažovanost investičního portfolia po úpravách | n11 3T |
| EBD1102 | Poměr angažovanosti invest.portfolia po úpravách ke kapitálu | pS4 2 |
| EBD1103 | Angažovanost obchodního portfolia | n11 3T |
| EBD1104 | Angaž.obchod. portfolia-součet zbýv. dlouhých pozic | n11 3T |

Datový typ údajů v datové oblasti:

proměnný

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

| <u>Kód</u> | <u>Název</u> | <u>Operátor : Hodnota</u> | <u>Název hodnoty</u> |
|------------|--|---------------------------|---|
| P0008 | Objekt vykazování | Několik : D_S_BANNEB1 | Typ subjektu - bankovní/nebankovní |
| P0048 | Objekt vykazování podle kombinovaného třídění | Několik : D_S_KLEKSK1 | Vztahy osob a economic. skupin k vyk.subj./ konsol. celku |
| P0064 | Ekonomicky spjatá skupina osob | Několik : an__5_I1 | Interval nad DT an__5 |
| P0097 | Jméno fyzické osoby / zkr. název právnické osoby | Několik : an_35_I1 | Doména nad dat. typem an_35 |

Datový soubor: DISIFE30

Akronym: BD (ČNB) 3-12

Datová oblast: DIS30_21

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

| <u>Kód</u> | <u>Název</u> | <u>Operátor : Hodnota</u> | <u>Název hodnoty</u> |
|------------|---|---------------------------|----------------------|
| P0158 | Datum narození (RRMMDD) občana nebo IČO | Několik : an10_I1 | Interval nad DT an10 |

Výčet konstantních parametrů datové oblasti:

| <u>Kód</u> | <u>Název</u> | <u>Operátor : Hodnota</u> | <u>Název hodnoty</u> |
|------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------------|
| P0011 | Časová charakteristika | Položka : 280 | Poslední den sledovaného období |
| P0013 | Povaha hodnoty ukazatele | Položka : 110 | Přepočtená skutečnost |
| P0014 | Typ ukazatele | Položka : 001 | Okamžikový údaj (stav) |
| P0019 | Struktura sledovaných měn | Položka : S_VSEMEN | Všechny měny |

Datový soubor: DISIFE30

Akronym: BD (ČNB) 3-12

Datová oblast: DIS30_21

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

| Parametry | P0009 Jednotka veličiny |
|--|--------------------------------------|
| Informační prvky | |
| EBD1100 Angažovanost investičního portfolia před úpravami | Položka : CZK Koruna česká |
| EBD1101 Angažovanost investičního portfolia po úpravách | Položka : CZK Koruna česká |
| EBD1102 Poměr angažovanosti invest.portfolia po úpravách ke kapitálu | Položka : 950 procento |
| EBD1103 Angažovanost obchodního portfolia | Položka : CZK Koruna česká |
| EBD1104 Angaž.obchod. portfolia-součet zbýv. dlouhých pozic | Položka : CZK Koruna česká |

Poznámka:

U ekonomicky spjatých skupin se uvádí název/ jméno hlavní osoby (klienta) včetně IČO (NIČO)/data narození. Kód ekonomicky spjaté skupiny musí být jedinečný. Osoby, které nejsou členy ekonomicky spjaté skupiny, mají místo kódu skupiny uvedenu hodnotu 99999.

Verze:13.0
Zdroj:ČNB

Stav:Platný
Garant:Karnet / odb. 416
Platnost od:01.01.2007

Datový soubor: DISIFE30

Akronym: BD (ČNB) 3-12

Datová oblast: DIS30_22

Název: Angažovanost jednotl. osob - členů ekonom. spjatých skupin

Charakteristika:

Datová oblast obsahuje hodnotu angažovanosti investičního portfolia po úpravách a hodnotu angažovanosti obchodního portfolia (vypočtenou jako součet zbývajících dlouhých pozic) vůči jednotlivým osobám - členům ekonomicky spjatých skupin, uvedených v DIS30_21. Při vykazování angažovanosti vůči jednotlivým osobám - členům ekonomicky spjaté skupiny se postupuje podle § 2, odst. 1, písm. f) vyhlášky ČNB č.xxx (dále jen Vyhláška).

Pro účely angažovanosti se započítává jakákoliv expozice představovaná aktivem v jeho účetní hodnotě před snížením o opravné položky nebo podrozvahovou položkou v účetní hodnotě bez odečtení rezerv vždy bez aplikace rizikových vah nebo konverzních faktorů podle §180 Vyhlášky.

Pokud povinná osoba zvolí možnost používat dosavadní pravidla angažovanosti (Basel 1) ve vazbě na § 239, odst. 1. a 2.d) Vyhlášky, pak postupuje podle přílohy č. 32, část C Vyhlášky.

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

| <u>Kód</u> | <u>Název</u> | <u>Datový typ údajů</u> |
|------------|---|-------------------------|
| EBD1101 | Angažovanost investičního portfolia po úpravách | |
| EBD1104 | Angaž.obchod. portfolia-součet zbýv. dlouhých pozic | |

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> |
|------------|--|---------------------------|---|
| P0008 | Objekt vykazování | Několik : D_S_BANNEB1 | Typ subjektu - bankovní/nebankovní |
| P0048 | Objekt vykazování podle kombinovaného třídění | Několik : D_S_ZVLVZT1 | Vztahy členů ekon. spjaté skup. osob k vyk. subjektu / KC |
| P0064 | Ekonomicky spjatá skupina osob | Několik : an_5_I1 | Interval nad DT an_5 |
| P0097 | Jméno fyzické osoby / zkr. název právnické osoby | Několik : an_35_I1 | Doména nad dat. typem an_35 |
| P0158 | Datum narození (RRMMDD) občana nebo IČO | Několik : an10_I1 | Interval nad DT an10 |

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 : 280 | Poslední den sledovaného období |
| P0013 | Povaha hodnoty ukazatele | Položka : 110 | Přepočtená skutečnost |
| P0014 | Typ ukazatele | Položka : 001 | Okamžikový údaj (stav) |
| P0019 | Struktura sledovaných měn | Položka : S_VSEMEN | Všechny měny |

Datový soubor: DISIFE30

Akronym: BD (ČNB) 3-12

Datová oblast: DIS30_22

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Kód ekonomické skupiny musí souhlasit s kódem uvedeným v datové oblasti DIS30_21.

Verze:13.0

Zdroj:ČNB

Stav:Platný

Garant:Karnet / odb. 416

Platnost od:01.01.2007

POPIS JEDNOVÝKAZOVÝCH KONTROL PRO DATOVÝ SOUBOR

Kód DS: DISIFE30

Akronym: BD (ČNB) 3-12

Krok kontroly: 10

Druh: err

Název:

Angaž. obch. portf. - celková a dl. pozic (osoby a ESS)

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0008:MD_S_BANNEB1,P0048:MD_S_KLEKSK1,
P0158:Man10_I1,P0097:Man_35_I1,P0064:Man_5_I1,
P0011.280,P0013.110,P0019.S_VSEMEN,P0014.001;
EBD1103 >= EBD1104 ODCH 2000 JELI EBD1104 >= 0;

Uživatelský tvar:

PRO
P0008:MD_S_BANNEB1,P0048:MD_S_KLEKSK1,P0158:Man10_I1,P0097:Man_35_I1,P0064:Man_5_I1;DIS30_21(N2,9>=N2,10 ODCH 2000 JELI N2,10>=0);

Poznámka:

Krok kontroly: 20

Druh: err

Název:

Angaž. obchod. portf. - celková a dl. pozic (součty)

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0008.S_BANNEB,P0011.280,P0013.110,P0019.S_VSEMEN,
P0048.S_KLEKSK,P0158:San10_I1,P0097:San_35_I1,
P0014.001,P0064:San_5_I1;
EBD1103 >= EBD1104 ODCH 2000 JELI EBD1104 >= 0;

Uživatelský tvar:

DIS30_21(N1,9>=N1,10 ODCH 2000 JELI N1,10>=0);

Poznámka:

Krok kontroly: 30

Druh: expl

Název:

Angaž. invest. portf. po úpravách - ESS se zvl. vztahem k bance

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0064:Man_5_I1, P0011.280, P0013.110, P0019.S_VSEMEN, P0014.001, P0009.CZK;
SUM EBD1101(P0008:MD_S_BANNEB1, P0048.520, P0158:Man10_I1, P0097:Man_35_I1) =
SUM EBD1101(P0008:MD_S_BANNEB1, P0048:MD_S_ZVLVZT1, P0158:Man10_I1,
P0097:Man_35_I1) ODCH 4000
JELI SUM EBD1101(P0008:MD_S_BANNEB1, P0048.530, P0158:Man10_I1, P0097:Man_35_I1)
> 0;

Uživatelský tvar:

PRO P0064:Man_5_I1;SUM DIS30_21(N2,7{P0048.520})=SUM DIS30_22(N1,6) ODCH 4000
JELI SUM DIS30_22(N1,6{P0048.530})>0;

Poznámka:

Krok kontroly: 40

Druh: expl

Název:

Angaž. invest. portf. po úpravách - ESS bez zvl. vztahu k bance

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0064:Man_5_I1, P0011.280, P0013.110, P0019.S_VSEMEN, P0014.001, P0009.CZK;
SUM EBD1101(P0008:MD_S_BANNEB1, P0048.525, P0158:Man10_I1, P0097:Man_35_I1) =

Popis JVK

Strana: 1/4

Kód DS: DISIFE30

Akronym: BD (ČNB) 3-12

Krok kontroly: 40

Druh: expl

Semantický tvar:

SUM EBD1101(P0008:MD_S_BANNEB1, P0048.535, P0158:Man10_I1, P0097:Man_35_I1)
ODCH 3000 JELI SUM EBD1101(P0008:MD_S_BANNEB1, P0048.530, P0158:Man10_I1,
P0097:Man_35_I1) = 0;

Uživatelský tvar:

PRO P0064:Man_5_I1;SUM DIS30_21(N2,7{P0048.525})=SUM DIS30_22(N1,6{P0048.535})
ODCH 3000 JELI SUM DIS30_22(N1,6{P0048.530})=0;

Poznámka:

Krok kontroly: 50

Druh: expl

Název:

Angaž. obchod. portf. (dl. pozic) - ESS se zvl. vztahem k bance

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0064:Man_5_I1, P0011.280, P0013.110, P0019.S_VSEMEN, P0014.001, P0009.CZK;
SUM EBD1104(P0008:MD_S_BANNEB1, P0048.520, P0158:Man10_I1, P0097:Man_35_I1)
=SUM EBD1104(P0008:MD_S_BANNEB1, P0048:MD_S_ZVLVZT1, P0158:Man10_I1,
P0097:Man_35_I1) ODCH 4000
JELI SUM EBD1104(P0008:MD_S_BANNEB1, P0048.530, P0158:Man10_I1, P0097:Man_35_I1)
> 0;

Uživatelský tvar:

PRO P0064:Man_5_I1;SUM DIS30_21(N2,10{P0048.520})=SUM DIS30_22(N1,7) ODCH 4000
JELI SUM DIS30_22(N1,7{P0048.530})>0;

Poznámka:

Krok kontroly: 60

Druh: expl

Název:

Angaž. obchod. portf. (dl. pozic) - ESS bez zvl. vztahu k bance

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0064:Man_5_I1, P0011.280, P0013.110, P0019.S_VSEMEN, P0014.001, P0009.CZK;
SUM EBD1104(P0008:MD_S_BANNEB1, P0048.525, P0158:Man10_I1, P0097:Man_35_I1) =
SUM EBD1104(P0008:MD_S_BANNEB1, P0048.535, P0158:Man10_I1, P0097:Man_35_I1)
ODCH 3000
JELI SUM EBD1104(P0008:MD_S_BANNEB1, P0048.530, P0158:Man10_I1, P0097:Man_35_I1)
= 0;

Uživatelský tvar:

PRO P0064:Man_5_I1;SUM DIS30_21(N2,10{P0048.525})=SUM DIS30_22(N1,7{P0048.535})
ODCH 3000 JELI SUM DIS30_22(N1,7{P0048.530})=0;

Poznámka:

Krok kontroly: 90

Druh: err

Název:

Poměr angažovanosti invest. portfolia po úpravách ke kapitálu

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0008:MD_S_BANNEB1, P0048:MD_S_KLEKSK1, P0158:Man10_I1,
P0097:Man_35_I1,
P0064:Man_5_I1, P0011.280, P0019.S_VSEMEN, P0014.001;
EBD1102(P0013.110, P0009.950) = EBD1101(P0013.110, P0009.CZK) /
EBD1693(P0009.CZK) * 100 ODCH 0.1 JELI EBD1693(P0009.CZK) <> 0;

Kód DS: DISIFE30

Akronym: BD (ČNB) 3-12

Krok kontroly: 90

Druh: err

Uživatelský tvar:

PRO

P0008:MD_S_BANNEB1,P0048:MD_S_KLEKSK1,P0158:Man10_I1,P0097:Man_35_I1,P0064:Man__5_I1;DIS30_21(N2,8)=DIS30_21(N2,7)/DIS30_11(N1,1)*100 ODCH 0.1 JELI DIS30_11(N1,1)<>0;

Poznámka:

Krok kontroly: 110

Druh: err

Název:

Vztah angažovanosti před úpravami a po nich (součty)

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0008.S_BANNEB,P0011.280,P0013.110,P0019.S_VSEMEN,P0048.S_KLEKSK,P0158:San10_I1,P0097:San_35_I1,P0014.001,P0064:San__5_I1;EBD1100 >= EBD1101 ODCH 2000 JELI EBD1101 >= 0;

Uživatelský tvar:

DIS30_21(N1,6>=N1,7 ODCH 2000 JELI N1,7>=0);

Poznámka:

Krok kontroly: 120

Druh: err

Název:

Vztah angažovanosti před úpravami a po nich (osoby a ESS)

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0008:MD_S_BANNEB1,P0048:MD_S_KLEKSK1,P0158:Man10_I1,P0097:Man_35_I1,P0064:Man__5_I1,P0011.280,P0013.110,P0019.S_VSEMEN,P0014.001;EBD1100 >= EBD1101 ODCH 2000 JELI EBD1101 >= 0;

Uživatelský tvar:

PRO

P0008:MD_S_BANNEB1,P0048:MD_S_KLEKSK1,P0158:Man10_I1,P0097:Man_35_I1,P0064:Man__5_I1;DIS30_21(N2,6>=N2,7 ODCH 2000 JELI N2,7>=0);

Poznámka:

Krok kontroly: 1010

Druh: err

Název:

EBD1100-Angažovanost investičního portfolia před úpravami (S_BANNEB,S_KLEKSK,an_35_I1) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0011.280, P0013.110, P0014.001, P0019.S_VSEMEN;SUM EBD1100(P0008:MD_S_BANNEB1, P0048:MD_S_KLEKSK1, P0097:Man_35_I1)=EBD1100(P0008.S_BANNEB, P0048.S_KLEKSK, P0097:San_35_I1) ODCH 5000;

Uživatelský tvar:

DIS30_21(SUM N2,6=N1,6 ODCH 5000);

Poznámka:

Kód DS: DISIFE30

Akronym: BD (ČNB) 3-12

Krok kontroly: 1020

Druh: err

Název:

EBD1101-Angažovanost investičního portfolia po úpravách(S_BANNEB,S_KLEKSK,an_35_I1) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0011.280, P0013.110, P0014.001, P0019.S_VSEMEN;
SUM EBD1101(P0008:MD_S_BANNEB1, P0048:MD_S_KLEKSK1, P0097:Man_35_I1)=
EBD1101(P0008.S_BANNEB, P0048.S_KLEKSK, P0097:San_35_I1) ODCH 5000;

Uživatelský tvar:

DIS30_21(SUM N2,7=N1,7 ODCH 5000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1030

Druh: err

Název:

EBD1103-Angažovanost obchodního portfolia(S_BANNEB,S_KLEKSK,an_35_I1) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0011.280, P0013.110, P0014.001, P0019.S_VSEMEN;
SUM EBD1103(P0008:MD_S_BANNEB1, P0048:MD_S_KLEKSK1, P0097:Man_35_I1)=
EBD1103(P0008.S_BANNEB, P0048.S_KLEKSK, P0097:San_35_I1) ODCH 5000;

Uživatelský tvar:

DIS30_21(SUM N2,9=N1,9 ODCH 5000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1040

Druh: err

Název:

EBD1104-Angaž.obchod. portfolia-součet zbýv. dlouhých pozic(S_BANNEB,S_KLEKSK,an_35_I1) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0011.280, P0013.110, P0014.001, P0019.S_VSEMEN;
SUM EBD1104(P0008:MD_S_BANNEB1, P0048:MD_S_KLEKSK1, P0097:Man_35_I1)=
EBD1104(P0008.S_BANNEB, P0048.S_KLEKSK, P0097:San_35_I1) ODCH 5000;

Uživatelský tvar:

DIS30_21(SUM N2,10=N1,10 ODCH 5000);

Poznámka: