

POPIS DATOVÉHO SOUBORU**Kód:** SISIFE03**Akronym:** VUS (ČNB) 3-12**Název:** Měsíční výkaz o úrokových sazbách neobch.dluh.cenných papírů**Charakteristika:**

Přehled stavu bankou emitovaných neobchodovatelných dluhových cenných papírů v držení rezidentů ČR (bez finančních a vládních institucí) ke konci měsíce (ve vazbě na rozvahový "Měsíční výkaz o cenných papírech emitovaných bankou VST(ČNB)22-12" (RISIFE22)) v členění dle propočtené úrokové sazby (tzv. anualizované sjednané sazby, případně úzce definované efektivní úrokové sazby), sektorů držitelů, vybraných měn, druhů cenných papírů, původně stanovené splatnosti při emisi a objemů bankou držených neobchodovatelných dluhových cenných papírů emitovaných nebankovními subjekty - rezidenty ČR (bez finančních a vládních institucí) ke konci měsíce (ve vazbě na rozvahový "Měsíční výkaz o cenných papírech a účastech v držení banky VST(ČNB)21-12" (RISIFE21)) v členění dle propočtené úrokové sazby (tzv. anualizované sjednané sazby, případně úzce definované efektivní úrokové sazby), sektorů emitentů, vybraných měn, druhů cenného papíru a původně stanovené splatnosti při emisi.

Části datového souboru:**Část:** 1 - Úrokové sazby emit.neobchod.cenných papírů**Přiřazené datové oblasti:**

Pořadí	Kód	Název
1	SIS03_01	Úrokové sazby ze stavů obchodů - emit.neobchod.cenné papíry

Část: 2 - Úrokové sazby držených neobchod.cen. papírů**Přiřazené datové oblasti:**

Pořadí	Kód	Název
1	SIS03_02	Úrokové sazby ze stavů obchodů - držené neobchod.cen. papíry

Vykaz.povinnost: VP_SISIFE03_1**Název** : Vykazovací povinnost pro SISIFE03**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_12-3	Do 20. následujícího měsíce

Poznámka:

Verze: 5.1	Stav: Platný	Platnost od: 02.01.2007
Zdroj: ČNB		
Garant věcného obsahu :Gregorová/odb.416		
Garant metodického popisu: Nováková/odb.416		

POPIS DATOVÝCH OBLASTÍ PRO DATOVÝ SOUBOR**Datový soubor:** SISIFE03**Akronym:** VUS (ČNB) 3-12**Název:** Měsíční výkaz o úrokových sazbách neobch.dluh.cenných papírů**Datová oblast:** SIS03_01**Název:** Úrokové sazby ze stavů obchodů - emit.neobchod.cenné papíry**Charakteristika:**

Objemy bankou emitovaných neobchodovatelných dluhových cenných papírů v držení rezidentů ČR dané bilančními zůstatky ke konci měsíce v členění dle propočtené úrokové sazby, tj. anualizované sjednané sazby, případně (zejména u komplexnějších produktů) úzce definované efektivní úrokové sazby (výše sazby s přesností na 2 desetinná místa), sektorů držitelů (nefinanční podniky, domácnosti, neziskové instituce sloužící domácnostem - rezidenti ČR), vybraných měn (CZK, EUR, USD), druhů cenných papírů (depozitní směnky, ostatní směnky, neobchodovatelné dluhopisy), původně stanovené splatnosti 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>
EPR1390_008	*Emitované neobchod.dluhové cenné papíry do 1 roku vč.	
EPR1390_009	*Emitované neobchod. dluhové cenné papíry nad 1 do 2 let vč.	
EPR1390_012	*Emitované neobchod.dluhové cenné papíry nad 5 let	
EPR1390_013	*Emitované neobchod dluh. cenné papíry nad 2 do 5 let vč.	

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 : 050	Poslední den sledovaného měsíce
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0125	Země (ekonomické teritorium)	Položka : CZ	Česká republika
P0186	Ocenění aktiv/pasiv	Položka : 23	Statistická nominální hodnota

Datový soubor: SISIFE03

Akronym: VUS (ČNB) 3-12

Datová oblast: SIS03_01

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Parametry	P0065 Smluvní doba splatnosti
Informační prvky	
EPR1390_008 *Emitované neobchod.dluhové cenné papíry do 1 roku vč.	Položka : 18 Do 1 roku včetně
EPR1390_009 *Emitované neobchod. dluhové cenné papíry nad 1 do 2 let vč.	Položka : 30 Nad 1 rok do 2 let včetně
EPR1390_012 *Emitované neobchod.dluhové cenné papíry nad 5 let	Položka : 39 Nad 5 let
EPR1390_013 *Emitované neobchod dluh. cenné papíry nad 2 do 5 let vč.	Položka : 31 Nad 2 roky do 5 let včetně

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: 4.0
Zdroj: ČNB

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

Datový soubor: SISIFE03

Akronym: VUS (ČNB) 3-12

Datová oblast: SIS03_02

Název: Úrokové sazby ze stavů obchodů - držené neobchod.cen. papíry

Charakteristika:

Objemy bankou držených neobchodovatelných dluhových cenných papírů emitovaných nebankovními subjekty - rezidenty ČR dané bilančními zůstatky ke konci období v členění dle propočtené úrokové sazby, tj. anualizované sjednané sazby, případně (zejména u komplexnějších produktů) úzce definované efektivní 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), původně stanovené splatnosti při emisi (hranice pásem: 1 rok, 5 let).

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
EAR1483_009	*Neobchod. dluh. cenné papíry v držení banky do 1 roku vč.	
EAR1483_013	*Neobchod. dluh.cenné papíry v držení banky nad 5 let	
EAR1483_014	*Neobchod.dluh.cenné papíry v drž. banky nad 1 do 5 let vč.	

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 : 050	Poslední den sledovaného měsíce
P0013	Povaha hodnoty ukazatele	Položka : 100	Skutečnost
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0034	Vazba údaje na opravné položky a oprávky	Položka : 0	Údaj nekompensovaný o opravné položky
P0125	Země (ekonomické teritorium)	Položka : CZ	Česká republika
P0186	Ocenění aktiv/pasiv	Položka : 23	Statistická nominální hodnota

Datový soubor: SISIFE03

Akronym: VUS (ČNB) 3-12

Datová oblast: SIS03_02

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Parametry	P0065
Informační prvky	Smluvní doba splatnosti
EAR1483_009 *Neobchod. dluh. cenné papíry v držení banky do 1 roku vč.	Položka : 18 Do 1 roku včetně
EAR1483_013 *Neobchod. dluh.cenné papíry v držení banky nad 5 let	Položka : 39 Nad 5 let
EAR1483_014 *Neobchod.dluh.cenné papíry v drž. banky nad 1 do 5 let vč.	Položka : 62 Nad 1 rok do 5 let včetně

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: 5.0
Zdroj: ČNB

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

POPIS JEDNOVÝKAZOVÝCH KONTROL PRO DATOVÝ SOUBOR

Kód DS: SISIFE03

Akronym: VUS (ČNB) 3-12

Krok kontroly: 1010

Druh: err

Název:

EPR1390_008-*Emitované neobchod.dluhové cenné papíry do 1 roku
vč.(S_3MENY,S_RNPDOM,p3_2_I1,S_NEOBCP) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.050, P0013.100, P0014.001, P0125.CZ, P0186.23;
SUM EPR1390_008(P0019:MD_S_3MENY1, P0036:MD_S_RNPDOM1, P0017:Mp3_2_I1,
P0088:MD_S_NEOBCP1)=
EPR1390_008(P0019.S_3MENY, P0036.S_RNPDOM, P0017:Sp3_2_I1, P0088.S_NEOBCP) ODCH
5000;

Uživatelský tvar:

SIS03_01(SUM N2,5=N1,5 ODCH 5000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1020

Druh: err

Název:

EPR1390_009-*Emitované neobchod. dluhové cenné papíry nad 1 do 2 let
vč.(S_3MENY,S_RNPDOM,p3_2_I1,S_NEOBCP) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.050, P0013.100, P0014.001, P0125.CZ, P0186.23;
SUM EPR1390_009(P0019:MD_S_3MENY1, P0036:MD_S_RNPDOM1, P0017:Mp3_2_I1,
P0088:MD_S_NEOBCP1)=
EPR1390_009(P0019.S_3MENY, P0036.S_RNPDOM, P0017:Sp3_2_I1, P0088.S_NEOBCP) ODCH
5000;

Uživatelský tvar:

SIS03_01(SUM N2,6=N1,6 ODCH 5000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1030

Druh: err

Název:

EPR1390_013-*Emitované neobchod dluh. cenné papíry nad 2 do 5 let
vč.(S_3MENY,S_RNPDOM,p3_2_I1,S_NEOBCP) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.050, P0013.100, P0014.001, P0125.CZ, P0186.23;
SUM EPR1390_013(P0019:MD_S_3MENY1, P0036:MD_S_RNPDOM1, P0017:Mp3_2_I1,
P0088:MD_S_NEOBCP1)=
EPR1390_013(P0019.S_3MENY, P0036.S_RNPDOM, P0017:Sp3_2_I1, P0088.S_NEOBCP) ODCH
5000;

Uživatelský tvar:

SIS03_01(SUM N2,7=N1,7 ODCH 5000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1040

Druh: err

Název:

EPR1390_012-*Emitované neobchod.dluhové cenné papíry nad 5
let(S_3MENY,S_RNPDOM,p3_2_I1,S_NEOBCP) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Kód DS: SISIFE03

Akronym: VUS (ČNB) 3-12

Krok kontroly: 1040

Druh: err

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.050, P0013.100, P0014.001, P0125.CZ, P0186.23;
SUM EPR1390_012(P0019:MD_S_3MENY1, P0036:MD_S_RNPDOM1, P0017:Mp3_2_I1,
P0088:MD_S_NEOBCP1)=
EPR1390_012(P0019.S_3MENY, P0036.S_RNPDOM, P0017:Sp3_2_I1, P0088.S_NEOBCP) ODCH
5000;

Uživatelský tvar:

SIS03_01(SUM N2,8=N1,8 ODCH 5000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1050

Druh: err

Název:

EAR1483_009-*Neobchod. dluh. cenné papíry v držení banky do 1 roku
vč. (S_3MENY,S_RNPDOM,p3_2_I1,S_NEOBCP) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.050, P0013.100, P0014.001, P0034.0, P0125.CZ, P0186.23;
SUM EAR1483_009(P0019:MD_S_3MENY1, P0036:MD_S_RNPDOM1, P0017:Mp3_2_I1,
P0088:MD_S_NEOBCP1)=
EAR1483_009(P0019.S_3MENY, P0036.S_RNPDOM, P0017:Sp3_2_I1, P0088.S_NEOBCP) ODCH
5000;

Uživatelský tvar:

SIS03_02(SUM N2,5=N1,5 ODCH 5000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1060

Druh: err

Název:

EAR1483_014-*Neobchod.dluh.cenné papíry v drž. banky nad 1 do 5 let
vč. (S_3MENY,S_RNPDOM,p3_2_I1,S_NEOBCP) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.050, P0013.100, P0014.001, P0034.0, P0125.CZ, P0186.23;
SUM EAR1483_014(P0019:MD_S_3MENY1, P0036:MD_S_RNPDOM1, P0017:Mp3_2_I1,
P0088:MD_S_NEOBCP1)=
EAR1483_014(P0019.S_3MENY, P0036.S_RNPDOM, P0017:Sp3_2_I1, P0088.S_NEOBCP) ODCH
5000;

Uživatelský tvar:

SIS03_02(SUM N2,6=N1,6 ODCH 5000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1070

Druh: err

Název:

EAR1483_013-*Neobchod. dluh.cenné papíry v držení banky nad 5
let (S_3MENY,S_RNPDOM,p3_2_I1,S_NEOBCP) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.050, P0013.100, P0014.001, P0034.0, P0125.CZ, P0186.23;
SUM EAR1483_013(P0019:MD_S_3MENY1, P0036:MD_S_RNPDOM1, P0017:Mp3_2_I1,
P0088:MD_S_NEOBCP1)=
EAR1483_013(P0019.S_3MENY, P0036.S_RNPDOM, P0017:Sp3_2_I1, P0088.S_NEOBCP) ODCH
5000;

Kód DS: SISIFE03

Akronym: VUS (ČNB) 3-12

Krok kontroly: 1070

Druh: err

Uživatelský tvar:

SIS03_02(SUM N2,7=N1,7 ODCH 5000);

Poznámka: