

POPIS DATOVÉHO SOUBORU**Kód:** TISIFE12**Akronym:** VT (ČNB) 2-12**Název:** Měsíční výkaz o změnách v ocenění cen. pap. v držení banky**Charakteristika:**

Přehled změn v ocenění cenných papírů v držení banky, které jsou přeceňovány na reálnou hodnotu nebo ekvivalenci, ke konci sledovaného období (měsíc), v členění podle zemí a sektorů (ESA95) protistran (emitentů CP), podle měn a u dluhových cenných papírů podle splatností.

Části datového souboru:**Část:** 1 - Změny v ocenění cenných papírů**Přiřazené datové oblasti:**

Pořadí	Kód	Název
1	TIS12_01	Změny v ocenění dluhových CP
2	TIS12_02	Změny v ocenění majetkových CP

Vykaz.povinnost: VP_TISIFE12**Název** : Vykazovací povinnost pro TISIFE12**Výčet a konkretizace výskytových parametrů datového souboru:**

Kód	Název parametru	O	Hodnota	Název hodnoty
P0002	Vykazující subjekt - banka, nebankovní subjekt	E	VSBACR	Banky a pobočky zahraničních bank působících v ČR včetně 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_9	Do 17. následujícího měsíce za leden

Poznámka:

Hodnota změn v ocenění cenných papírů se stanovuje na netto principu na základě tzv. bilanční metody, která těmito změnami rozumí výnosy resp. ztráty z držby cenných papírů (nerealizované výnosy, resp. ztráty). Jedná se tedy o změny v ocenění těch cenných papírů, které banka držela po celé sledované období (tj. na začátku, na konci i v průběhu celého vykazovacího období). Zahrnutý nejsou realizované výnosy, resp. ztráty, tj. výnosy, resp. ztráty z prodeje a nákupů cenných papírů.

Změna v ocenění cenných papírů se určí jako rozdíl mezi reálnou hodnotou cenného papíru na konci vykazovaného a předchozího období. U cenných papírů denominovaných v cizích měnách se vykazují pouze změny reálné hodnoty, které vyplývají ze změn cen sledovaných papírů vyjádřených v příslušných cizích měnách bez vlivu kurzových rozdílů, tj. rozdíl mezi reálnou hodnotou vyjádřenou v původní měně aktiva na konci vykazovaného a předchozího období přepočtený do české měny kurzem platným ke konci vykazovaného období.

V závislosti na růstu nebo poklesu reálné hodnoty budou vykazované hodnoty změn v ocenění cenných papírů kladné nebo záporné. Při vzrůstu reálné hodnoty ke konci sledovaného období ve srovnání s koncem předchozího období bude jako změna v ocenění vykazována kladná hodnota, při poklesu reálné hodnoty záporná hodnota. Pokud reálné hodnoty některých sledovaných papírů rostou a jiné klesají, pak se v příslušné skupině cenných papírů (definované podle druhu cenného papíru, sektoru, země, měny atd.) od sebe kladné a záporné změny navzájem odečtou a do výkazu se uvede výsledná hodnota s příslušným znaménkem.

Kód: TISIFE12

Akronym: VT (ČNB) 2-12

Název: Měsíční výkaz o změnách v ocenění cen. pap. v držení banky

Verze:11.0

Stav:Platný

Platnost od:01.01.2009

Zdroj:ČNB

Garant věcného obsahu :Novák/odb. 416

Garant metodického popisu:Novák/odb. 416

POPIS DATOVÝCH OBLASTÍ PRO DATOVÝ SOUBOR**Datový soubor:** TISIFE12**Akronym:** VT (ČNB) 2-12**Název:** Měsíční výkaz o změnách v ocenění cen. pap. v držení banky**Datová oblast:** TIS12_01**Název:** Změny v ocenění dluhových CP**Charakteristika:**

Změny v ocenění dluhových cenných papírů v aktivech banky, které jsou přeceňovány na reálnou hodnotu nebo ekvivalenci, ke konci sledovaného období v členění podle splatností a měn, a podle zemí a ekonomických sektorů protistran (emitentů).

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
ETO0005	Změny v ocenění cenných papírů	

Datový typ údajů v datové oblasti:

nS11 3T - n14 (11čís. znaků se znam.+ 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>
P0019	Struktura sledovaných měn	Několik : D_S_VSEMEN3	Všechny měny
P0036	Objekt vykazování podle sektorů ESA95	Několik : D_S_ESACNB8	Rezidenti a nerezidenti celkem
P0065	Smluvní doba splatnosti	Výčet : ZODPCP1	Intervaly - do 1 roku vč., nad 1r.do 2, nad 2 do 5, nad 5 let
P0125	Země (ekonomické teritorium)	Několik : D_S_ZEMTEROR2	Všechny země včetně vybraných teritorií a mezinárod. org.

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 : 410	Obratový údaj (inkasa, platby, čerpání ap.)
P0034	Vazba údaje na opravné položky a oprávky	Položka : 0	Údaj nekompenzovaný o opravné položky
P0088	Druh cenného papíru	Položka : S_DLUHAKUP	Dluhopisy a kupóny
P0911	Kotované akcie	Položka : S_AN	Ano, ne

Datový soubor: TISIFE12

Akronym: VT (ČNB) 2-12

Datová oblast: TIS12_01

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Při kombinaci parametrů P0036 a P0125 se vykazují k příslušné zemi (skupině zemí) protistrany které jsou rezidenty dané země (pro země jiné než ČR to jsou nerezidenti vůči ČR s kódy sektorů 2xxxxxx; pro ČR je možná jen kombinace s rezidentskými sektory s kódy 1xxxxxx).

Verze: 9.0

Zdroj: ČNB

Stav: Platný

Garant: Novák / odb.416

Platnost od: 01.01.2009

Datový soubor: TISIFE12

Akronym: VT (ČNB) 2-12

Datová oblast: TIS12_02

Název: Změny v ocenění majetkových CP

Charakteristika:

Změny v ocenění majetkových cenných papírů v aktivech banky, které jsou přeceňovány na reálnou hodnotu nebo ekvivalenci, ke konci sledovaného období v členění podle druhu cenných papírů a měn a podle zemí a ekonomických sektorů protistran (emitentů).

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
ETO0005	Změny v ocenění cenných papírů	

Datový typ údajů v datové oblasti:

nS11 3T - n14 (11čís. znaků se znam.+ 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>
P0019	Struktura sledovaných měn	Několik : D_S_VSEMEN3	Všechny měny
P0036	Objekt vykazování podle sektorů ESA95	Několik : D_S_ESACNB8	Rezidenti a nerezidenti celkem
P0088	Druh cenného papíru	Výčet : ZMAJCP	Majetkové cenné papíry
P0125	Země (ekonomické teritorium)	Několik : D_S_ZEMTEROR2	Všechny země včetně vybraných teritorií a mezinárod. org.
P0911	Kotované akcie	Výčet : ZANONE	Kótování akcií

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 : 410	Obrátový údaj (inkasa, platby, čerpání ap.)
P0034	Vazba údaje na opravné položky a oprávk	Položka : 0	Údaj nekompenzovaný o opravné položky
P0065	Smluvní doba splatnosti	Položka : 95	Nespecifikováno

Datový soubor: TISIFE12

Akronym: VT (ČNB) 2-12

Datová oblast: TIS12_02

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Při kombinaci parametrů P0036 a P0125 se vykazují k příslušné zemi (skupině zemí) protistrany které jsou rezidenty dané země (pro země jiné než ČR to jsou nerezidenti vůči ČR s kódy sektorů 2xxxxxx; pro ČR je možná jen kombinace s rezidentskými sektory s kódy 1xxxxxx).

Verze: 9.0

Zdroj: ČNB

Stav: Platný

Garant: Novák / odb.416

Platnost od: 01.01.2009

POPIS JEDNOVÝKAZOVÝCH KONTROL PRO DATOVÝ SOUBOR

Kód DS: TISIFE12

Akronym: VT (ČNB) 2-12

Krok kontroly: 10

Druh: err

Název:

Nepovolená kombinace rezidenti vs. všechny země kromě ČR - TIS12_01

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0019:MD_S_VSEMEN3, P0036:MZ_REZVSE, P0125:MZBEZCZ3, P0009.CZK, P0011.440,
P0013.100, P0034.0, P0014.410, P0088.S_DLUHAKUP;
ETO0005(P0065.18) = NULL A ETO0005(P0065.30) = NULL A ETO0005(P0065.31) = NULL A
ETO0005(P0065.39) = NULL ;

Uživatelský tvar:

PRO P0019:MD_S_VSEMEN3,P0036:MZ_REZVSE,P0125:MZBEZCZ3;TIS12_01(N2,4=NULL A
N2,5=NULL A N2,6=NULL A N2,7=NULL);

Poznámka:

Krok kontroly: 20

Druh: err

Název:

Nepovolená kombinace nerezidenti vs. ČR - TIS12_01

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0019:MD_S_VSEMEN3, P0036:MZ_NERVSE, P0125.CZ, P0009.CZK, P0011.440,
P0013.100, P0034.0, P0014.410, P0088.S_DLUHAKUP;
ETO0005(P0065.18) = NULL A ETO0005(P0065.30) = NULL A ETO0005(P0065.31) = NULL A
ETO0005(P0065.39) = NULL;

Uživatelský tvar:

PRO P0019:MD_S_VSEMEN3,P0036:MZ_NERVSE,P0125.CZ;TIS12_01(N2,4=NULL A N2,5=NULL A
N2,6=NULL A N2,7=NULL);

Poznámka:

Krok kontroly: 30

Druh: err

Název:

Nepovolená kombinace rezidenti vs. všechny země kromě ČR - TIS12_02

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0019:MD_S_VSEMEN3, P0036:MZ_REZVSE, P0125:MZBEZCZ3, P0009.CZK, P0011.440,
P0013.100, P0034.0, P0014.410, P0065.95;
ETO0005(P0088.S_AKPLFPT, P0911.S_AN) = NULL A ETO0005(P0088.S_AKBPTZL, P0911.N)
= NULL A
ETO0005(P0088.S_AKBPTZL, P0911.Y) = NULL A ETO0005(P0088.S_AKPLOF, P0911.S_AN) =
NULL A ETO0005(P0088.S_MPJCPKU, P0911.S_AN) = NULL ;

Uživatelský tvar:

PRO P0019:MD_S_VSEMEN3,P0036:MZ_REZVSE,P0125:MZBEZCZ3;TIS12_02(N2,4=NULL A
N2,7=NULL A N2,8=NULL A N2,9=NULL A N2,12=NULL);

Poznámka:

Krok kontroly: 40

Druh: err

Název:

Nepovolená kombinace nerezidenti vs. ČR - TIS12_02

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0019:MD_S_VSEMEN3, P0036:MZ_NERVSE, P0125.CZ, P0009.CZK, P0011.440,
P0013.100, P0034.0, P0014.410, P0065.95;
ETO0005(P0088.S_AKPLFPT, P0911.S_AN) = NULL A ETO0005(P0088.S_AKBPTZL, P0911.N)

Popis JVK

Strana: 1/5

Kód DS: TISIFE12

Akronym: VT (ČNB) 2-12

Krok kontroly: 40

Druh: err

Semantický tvar:

= NULL A ETO0005(P0088.S_AKBPTZL, P0911.Y) = NULL A ETO0005(P0088.S_AKPLOF, P0911.S_AN) = NULL A ETO0005(P0088.S_MPJCPKU, P0911.S_AN) = NULL ;

Uživatelský tvar:

PRO P0019:MD_S_VSEMEN3,P0036:MZ_NERVSE,P0125.CZ;TIS12_02(N2,4=NULL A N2,7=NULL A N2,8=NULL A N2,9=NULL A N2,12=NULL);

Poznámka:

Krok kontroly: 50

Druh: warn

Název:

Nepovolená kombinace Akcie/PL FPT vs. sektory jiné než FPT (rezidenti)

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0019:MD_S_VSEMEN3, P0036:MZ_BEZFPT2, P0125:MD_S_ZEMTEROR2, P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0034.0, P0014.410, P0065.95, P0088.S_AKPLFPT, P0911.S_AN; ETO0005 = NULL ;

Uživatelský tvar:

PRO

P0019:MD_S_VSEMEN3,P0036:MZ_BEZFPT2,P0125:MD_S_ZEMTEROR2;TIS12_02(N2,4=NULL);

Poznámka:

Krok kontroly: 60

Druh: warn

Název:

Nepovolená kombinace MO

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0019:MD_S_VSEMEN3, P0036.2009030, P0125:MZOSTZEM, P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0034.0, P0014.410, P0088.S_DLUHAKUP; ETO0005(P0065.18) = NULL A ETO0005(P0065.30) = NULL A ETO0005(P0065.31) = NULL A ETO0005(P0065.39) = NULL ;

Uživatelský tvar:

PRO P0019:MD_S_VSEMEN3,P0036.2009030,P0125:MZOSTZEM;TIS12_01(N2,4=NULL A N2,5=NULL A N2,6=NULL A N2,7=NULL);

Poznámka:

Krok kontroly: 70

Druh: warn

Název:

Nepovolená kombinace MO

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0019:MD_S_VSEMEN3, P0036.2009030, P0125:MZOSTZEM, P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0034.0, P0014.410, P0065.95; ETO0005(P0088.S_AKPLFPT, P0911.S_AN) = NULL A ETO0005(P0088.S_AKBPTZL, P0911.N) = NULL A ETO0005(P0088.S_AKBPTZL, P0911.Y) = NULL A ETO0005(P0088.S_AKPLOF, P0911.S_AN) = NULL A ETO0005(P0088.S_MPJCPKU, P0911.S_AN) = NULL;

Uživatelský tvar:

PRO P0019:MD_S_VSEMEN3,P0036.2009030,P0125:MZOSTZEM;TIS12_02(N2,4=NULL A N2,7=NULL A N2,8=NULL A N2,9=NULL A N2,12=NULL);

Poznámka:

Kód DS: TISIFE12

Akronym: VT (ČNB) 2-12

Krok kontroly: 80

Druh: err

Název:

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0034.0, P0014.410, P0065.95,
P0088.S AKPLFPT, P0911.S AN;
SUM ETO0005(P0019:MD_S_VSEMEN3, P0036:MD_S_ESACNB8, P0125:MD_S_ZEMTEROR2) =
ETO0005(P0019.S_VSEMEN, P0036.S_ESACNB, P0125.S_ZEMTEROR) ODCH 5000;

Uživatelský tvar:

TIS12_02(SUM N2,4=N1,4 ODCH 5000);

Poznámka:

Krok kontroly: 90

Druh: err

Název:

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0014.410, P0034.0, P0065.95,
P0088.S AKPLOF, P0911.S AN;
SUM ETO0005(P0019:MD_S_VSEMEN3, P0036:MD_S_ESACNB8, P0125:MD_S_ZEMTEROR2)=
ETO0005(P0019.S_VSEMEN, P0036.S_ESACNB, P0125.S_ZEMTEROR) ODCH 5000;

Uživatelský tvar:

TIS12_02(SUM N2,9=N1,9 ODCH 5000);

Poznámka:

Krok kontroly: 100

Druh: err

Název:

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0014.410, P0034.0, P0065.95,
P0088.S MPJCPKU, P0911.S AN;
SUM ETO0005(P0019:MD_S_VSEMEN3, P0036:MD_S_ESACNB8, P0125:MD_S_ZEMTEROR2)=
ETO0005(P0019.S_VSEMEN, P0036.S_ESACNB, P0125.S_ZEMTEROR) ODCH 5000;

Uživatelský tvar:

TIS12_02(SUM N2,12=N1,12 ODCH 5000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1010

Druh: err

Název:

ETO0005-Změny v ocenění cenných papírů(S_VSEMEN,S_ESACNB,18,S_ZEMTEROR) = součet
elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0014.410, P0034.0, P0065.18,
P0088.S DLUHAKUP, P0911.S AN;
SUM ETO0005(P0019:MD_S_VSEMEN3, P0036:MD_S_ESACNB8, P0125:MD_S_ZEMTEROR2)=
ETO0005(P0019.S_VSEMEN, P0036.S_ESACNB, P0125.S_ZEMTEROR) ODCH 5000;

Uživatelský tvar:

TIS12_01(SUM N2,4=N1,4 ODCH 5000);

Poznámka:

Kód DS: TISIFE12

Akronym: VT (ČNB) 2-12

Krok kontroly: 1020

Druh: err

Název:

ETO0005-Změny v ocenění cenných papírů(S_VSEMEN,S_ESACNB,30,S_ZEMTEROR) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0014.410, P0034.0, P0065.30,
P0088.S_DLUHAKUP, P0911.S_AN;
SUM ETO0005(P0019:MD_S_VSEMEN3, P0036:MD_S_ESACNB8, P0125:MD_S_ZEMTEROR2)=
ETO0005(P0019.S_VSEMEN, P0036.S_ESACNB, P0125.S_ZEMTEROR) ODCH 5000;

Uživatelský tvar:

TIS12_01(SUM N2,5=N1,5 ODCH 5000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1030

Druh: err

Název:

ETO0005-Změny v ocenění cenných papírů(S_VSEMEN,S_ESACNB,31,S_ZEMTEROR) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0014.410, P0034.0, P0065.31,
P0088.S_DLUHAKUP, P0911.S_AN;
SUM ETO0005(P0019:MD_S_VSEMEN3, P0036:MD_S_ESACNB8, P0125:MD_S_ZEMTEROR2)=
ETO0005(P0019.S_VSEMEN, P0036.S_ESACNB, P0125.S_ZEMTEROR) ODCH 5000;

Uživatelský tvar:

TIS12_01(SUM N2,6=N1,6 ODCH 5000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1040

Druh: err

Název:

ETO0005-Změny v ocenění cenných papírů(S_VSEMEN,S_ESACNB,39,S_ZEMTEROR) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0014.410, P0034.0, P0065.39,
P0088.S_DLUHAKUP, P0911.S_AN;
SUM ETO0005(P0019:MD_S_VSEMEN3, P0036:MD_S_ESACNB8, P0125:MD_S_ZEMTEROR2)=
ETO0005(P0019.S_VSEMEN, P0036.S_ESACNB, P0125.S_ZEMTEROR) ODCH 5000;

Uživatelský tvar:

TIS12_01(SUM N2,7=N1,7 ODCH 5000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1050

Druh: err

Název:

ETO0005-Změny v ocenění cenných papírů(S_VSEMEN,S_ESACNB,S_AKBPTZL,S_ZEMTEROR,N) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0014.410, P0034.0, P0065.95,
P0088.S_AKBPTZL, P0911.N;
SUM ETO0005(P0019:MD_S_VSEMEN3, P0036:MD_S_ESACNB8, P0125:MD_S_ZEMTEROR2)=
ETO0005(P0019.S_VSEMEN, P0036.S_ESACNB, P0125.S_ZEMTEROR) ODCH 5000;

Kód DS: TISIFE12

Akronym: VT (ČNB) 2-12

Krok kontroly: 1050

Druh: err

Uživatelský tvar:

TIS12_02(SUM N2,7=N1,7 ODCH 5000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1060

Druh: err

Název:

ETO0005-Změny v ocenění cenných papírů(S_VSEMEN,S_ESACNB,S_AKBPTZL,S_ZEMTEROR,Y)
= součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.440, P0013.100, P0014.410, P0034.0, P0065.95,
P0088.S_AKBPTZL, P0911.Y;

SUM ETO0005(P0019:MD_S_VSEMEN3, P0036:MD_S_ESACNB8, P0125:MD_S_ZEMTEROR2)=
ETO0005(P0019.S_VSEMEN, P0036.S_ESACNB, P0125.S_ZEMTEROR) ODCH 5000;

Uživatelský tvar:

TIS12_02(SUM N2,8=N1,8 ODCH 5000);

Poznámka: