

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**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: 5.0	Stav: Platný	Platnost od: 01.01.2010
Zdroj: ČNB		
Garant věcného obsahu	: Černá/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
Informační prvky	Smluvní doba splatnosti
EPN0002_001 Emit. neobch. CP - splatnost do 1 roku včetně	Položka : 18 Do 1 roku včetně
EPN0002_002 Emit. neobch. CP - splatnost nad 1 rok až do 2 let včetně	Položka : 30 Nad 1 rok do 2 let včetně
EPN0002_003 Emit. neobch. CP - splatnost nad 2 roky až do 5 let včetně	Položka : 31 Nad 2 roky do 5 let včetně
EPN0002_004 Emit. neobch. CP - splatnost nad 5 let	Položka : 39 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: 5.0
Zdroj: ČNB

Stav: Platný
Garant: Nováková / odb.416
Platnost od: 01.01.2010

Datový soubor: SISIFE13

Akronym: VUS (ČNB) 13-12

Datová oblast: SIS13_02

Název: Úrokové sazby z nových obchodů - nákup. 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_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_02

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Parametry	P0065
	Smluvní doba splatnosti
Informační prvky	
EAN0003_001 Nakoup. neobch. CP - splatnost do 1 roku včetně	Položka : 18 Do 1 roku včetně
EAN0003_002 Nakoup. neobch. CP - splatnost nad 1 rok až do 5 let včetně	Položka : 62 Nad 1 rok do 5 let včetně
EAN0003_003 Nakoup. neobch. CP - splatnost nad 5 let	Položka : 39 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: 5.0
Zdroj: ČNB

Stav: Platný
Garant: Nováková / odb.416
Platnost od: 01.01.2010

POPIS JEDNOVÝKAZOVÝCH KONTROL PRO DATOVÝ SOUBOR

Kód DS: SISIFE13

Akronym: VUS (ČNB) 13-12

Krok kontroly: 1010

Druh: err

Název:

EPN0002_001-Emit. 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 EPN0002_001(P0019:MD_S_3MENY1, P0036:MD_S_RNPDOM1, P0017:Mp3_2_I1,
P0088:MD_S_NEOBCP1)=
EPN0002_001(P0019.S_3MENY, P0036.S_RNPDOM, P0017:Sp3_2_I1, P0088.S_NEOBCP) 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_NEOBCP) = 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,
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:

Kód DS: SISIFE13

Akronym: VUS (ČNB) 13-12

Krok kontroly: 1040

Druh: err

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;

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;

Kód DS: SISIFE13

Akronym: VUS (ČNB) 13-12

Krok kontroly: 1070

Druh: err

Uživatelský tvar:

SIS13_02(SUM N2,7=N1,7 ODCH 5000);

Poznámka: