

**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 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

Výkaz.povinnost: VP\_SISIFE03\_1

Název : Výkazovací 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: 7.0	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:** 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_NEOBCEP1	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
<b>Informační prvky</b>	Smluvní doba splatnosti
<b>EPR1390_008</b> *Emitované neobchod.dluhové cenné papíry do 1 roku vč.	<b>Položka : 18</b> Do 1 roku včetně
<b>EPR1390_009</b> *Emitované neobchod. dluhové cenné papíry nad 1 do 2 let vč.	<b>Položka : 30</b> Nad 1 rok do 2 let včetně
<b>EPR1390_012</b> *Emitované neobchod.dluhové cenné papíry nad 5 let	<b>Položka : 39</b> Nad 5 let
<b>EPR1390_013</b> *Emitované neobchod dluh. cenné papíry nad 2 do 5 let vč.	<b>Položka : 31</b> 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:** 5.0  
**Zdroj:** ČNB

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

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 oprávký	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
<b>Informační prvky</b>	Smluvní doba splatnosti
<b>EAR1483_009</b> *Neobchod. dluh. cenné papíry v držení banky do 1 roku vč.	<b>Položka : 18</b> Do 1 roku včetně
<b>EAR1483_013</b> *Neobchod. dluh.cenné papíry v držení banky nad 5 let	<b>Položka : 39</b> Nad 5 let
<b>EAR1483_014</b> *Neobchod.dluh.cenné papíry v drž. banky nad 1 do 5 let vč.	<b>Položka : 62</b> 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:** 6.0  
**Zdroj:** ČNB

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

**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:**