

POPIS DATOVÉHO SOUBORU**Kód:** DISIFE21**Akronym:** BD (ČNB) 21-01**Název:** Doplnkové údaje pro stanovení kap. pož. k oper. riziku banky**Charakteristika:**

Datový soubor obsahuje hodnoty relevantního a alternativního ukazatele pro stanovení kapitálového požadavku k operačnímu riziku pro aktivity povinné osoby při přístupu základního ukazatele (přístup BIA), při standardizovaném přístupu (přístup TSA), při alternativním standardizovaném přístupu (přístup ASA) a při pokročilém přístupu (přístup AMA) ve vazbě na část čtvrtou, hlava IV, díl 4 vyhlášky č.123/2007 Sb. ve znění pozdějších předpisů.

U výkazů předkládaných nepravdělně po změně / rozhodné události se výkaz sestavuje k poslednímu kalendářnímu dni měsíce, ve kterém došlo ke změně / rozhodné události, a tento den se použije pro konkretizaci parametru P0053 - Stav ke dni.

Části datového souboru:**Část:** 1 - Kap. pož. k operačnímu riziku**Přiřazené datové oblasti:**

Pořadí	Kód	Název
1	DIS21_01	Údaje pro aktivity při BIA, TSA, ASA a AMA

Výkaz.povinnost: VP_DISIFE21**Název** : Vykazovací povinnost pro DISIFE21**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	=	01	Roční
P0060	Termín předkládání	E	ZM_78	28. kalend. den po konci dubna a rozhodné události

Poznámka:

Verze: 4.0	Stav: Platný	Platnost od: 01.01.2012
Zdroj:		
Garant věcného obsahu :Marcinová/odb.563		
Garant metodického popisu: Slavíková/odb.563		

POPIS DATOVÝCH OBLASTÍ PRO DATOVÝ SOUBOR**Datový soubor:** DISIFE21**Akronym:** BD (ČNB) 21-01**Název:** Doplnkové údaje pro stanovení kap. pož. k oper. riziku banky**Datová oblast:** DIS21_01**Název:** Údaje pro aktivity při BIA, TSA, ASA a AMA**Charakteristika:**

Datová oblast obsahuje hodnoty relevantního a alternativního ukazatele pro stanovení kapitálového požadavku k operačnímu riziku pro aktivity povinné osoby při přístupu základního ukazatele (přístup BIA), při standardizovaném přístupu (přístup TSA), při alternativním standardizovaném přístupu (přístup ASA) a při pokročilém přístupu AMA ve vazbě na část čtvrtou, hlava IV, díl 4 vyhlášky č. 123/2007 Sb..

Výčet informačních prvků v datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Datový typ údajů</u>
EBD1592	Hodnota relevantního ukazatele	
EBD1655	Hodnota alternativního ukazatele	

Datový typ údajů v datové oblasti:

nS11T - n11 (11 číselných znaků se znaménkem v násobku 1 tisíc)

Výčet dimenzionálních parametrů datové oblasti:

<u>Kód</u>	<u>Název</u>	<u>Operátor : Hodnota</u>	<u>Název hodnoty</u>
P0011	Časová charakteristika	Výčet : Z_OBDOB	Zásobník - minulé, předminulé a předpředminulé období
P0142	Aktivita/ linie podnikání sledovaná v operačním riziku	Výčet : Z_BANKAKTIV	Zásobník pro aktivity a linie podnikání - operační riziko

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
P0014	Typ ukazatele	Položka : 001	Okamžikový údaj (stav)
P0019	Struktura sledovaných měn	Položka : S_VSEMEN	Všechny měny

Datový soubor: DISIFE21

Akronym: BD (ČNB) 21-01

Datová oblast: DIS21_01

Výčet informačních prvků s rozdílnou a proměnnou konkretizací parametrů:

Informační prvky s rozdílnou konkretizací neexistují.

Poznámka:

Verze: 4.0

Zdroj: ČNB

Stav: Platný

Platnost od: 01.01.2011

Garant: M.Slavíková / odb.416

POPIS JEDNOVÝKAZOVÝCH KONTROL PRO DATOVÝ SOUBOR

Kód DS: DISIFE21

Akronym: BD (ČNB) 21-01

Krok kontroly: 1010

Druh: err

Název:

EBD1592-Hodnota relevantního ukazatele(272,S_TSA) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.272, P0014.001, P0019.S_VSEMEN; EBD1592(P0142.16) + EBD1592(P0142.20) + EBD1592(P0142.24) + EBD1592(P0142.28) + EBD1592(P0142.32) + EBD1592(P0142.36) + EBD1592(P0142.40) + EBD1592(P0142.44)= EBD1592(P0142.S_TSA) ODCH 3000;

Uživatelský tvar:

DIS21_01(N3,1+N4,1+N5,1+N6,1+N7,1+N8,1+N9,1+N10,1=N2,1 ODCH 3000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1020

Druh: err

Název:

EBD1592-Hodnota relevantního ukazatele(271,S_TSA) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.271, P0014.001, P0019.S_VSEMEN; EBD1592(P0142.16) + EBD1592(P0142.20) + EBD1592(P0142.24) + EBD1592(P0142.28) + EBD1592(P0142.32) + EBD1592(P0142.36) + EBD1592(P0142.40) + EBD1592(P0142.44)= EBD1592(P0142.S_TSA) ODCH 3000;

Uživatelský tvar:

DIS21_01(N3,2+N4,2+N5,2+N6,2+N7,2+N8,2+N9,2+N10,2=N2,2 ODCH 3000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1030

Druh: err

Název:

EBD1592-Hodnota relevantního ukazatele(273,S_TSA) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.273, P0014.001, P0019.S_VSEMEN; EBD1592(P0142.16) + EBD1592(P0142.20) + EBD1592(P0142.24) + EBD1592(P0142.28) + EBD1592(P0142.32) + EBD1592(P0142.36) + EBD1592(P0142.40) + EBD1592(P0142.44)= EBD1592(P0142.S_TSA) ODCH 3000;

Uživatelský tvar:

DIS21_01(N3,3+N4,3+N5,3+N6,3+N7,3+N8,3+N9,3+N10,3=N2,3 ODCH 3000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1040

Druh: err

Název:

EBD1592-Hodnota relevantního ukazatele(272,S_ASA) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.272, P0014.001, P0019.S_VSEMEN; EBD1592(P0142.48) + EBD1592(P0142.52) + EBD1592(P0142.45) + EBD1592(P0142.46) + EBD1592(P0142.47) + EBD1592(P0142.54) + EBD1592(P0142.56) + EBD1592(P0142.58)= EBD1592(P0142.S_ASA) ODCH 3000;

Uživatelský tvar:

DIS21_01(N15,1+N16,1+N12,1+N13,1+N14,1+N17,1+N18,1+N19,1=N11,1 ODCH 3000);

Poznámka:

Kód DS: DISIFE21

Akronym: BD (ČNB) 21-01

Krok kontroly: 1050

Druh: err

Název:

EBD1592-Hodnota relevantního ukazatele(271,S_ASA) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.271, P0014.001, P0019.S_VSEMEN; EBD1592(P0142.48) +
EBD1592(P0142.52) + EBD1592(P0142.45) + EBD1592(P0142.46) + EBD1592(P0142.47) +
EBD1592(P0142.54) + EBD1592(P0142.56) + EBD1592(P0142.58)= EBD1592(P0142.S_ASA)
ODCH 3000;

Uživatelský tvar:

DIS21_01(N15,2+N16,2+N12,2+N13,2+N14,2+N17,2+N18,2+N19,2=N11,2 ODCH 3000);

Poznámka:

Krok kontroly: 1060

Druh: err

Název:

EBD1592-Hodnota relevantního ukazatele(273,S_ASA) = součet elementárních údajů;

Charakteristika:

Semantický tvar:

PRO P0009.CZK, P0011.273, P0014.001, P0019.S_VSEMEN; EBD1592(P0142.48) +
EBD1592(P0142.52) + EBD1592(P0142.45) + EBD1592(P0142.46) + EBD1592(P0142.47) +
EBD1592(P0142.54) + EBD1592(P0142.56) + EBD1592(P0142.58)= EBD1592(P0142.S_ASA)
ODCH 3000;

Uživatelský tvar:

DIS21_01(N15,3+N16,3+N12,3+N13,3+N14,3+N17,3+N18,3+N19,3=N11,3 ODCH 3000);

Poznámka: