

„C 16.01 – OPERAČNÍ RIZIKO – KAPITÁLOVÉ POŽADAVKY (OPR OF)“

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **C 16.01 – OPERAČNÍ RIZIKO – Kapitálové požadavky (OPR OF)** | | | | | | |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | | **Hodnota** |  |  | **Kapitálové požadavky** | **Objem rizikové expozice** |
| **Z toho: úpravy kvůli fúzi/nabytí subjektů nebo činností** | **(Úpravy kvůli pozbytí subjektů nebo činností)** |
| 0010 | 0020 | 0030 | 0040 | 0050 |
| 0010 | **Složka obchodního ukazatele a alternativní standardizovaný přístup (ASA)** |  |  |  |  |  |
| 0020 | Obchodní ukazatel |  |  |  |  |  |
| 0030 | **Úroková, leasingová a dividendová složka (ILDC)** |  |  |  |  |  |
| 0040 | ILDC ve vztahu k jednotlivé instituci / konsolidované skupině (vyjma subjektů uvedených v čl. 314 odst. 3) |  |  |  |  |  |
| 0050 | ILDC u subjektů uvedených v čl. 314 odst. 3 |  |  |  |  |  |
| 0060 | **Složka služeb** |  |  |  |  |  |
| 0070 | **Finanční složka** |  |  |  |  |  |
| 0080 | **ASA podle čl. 314 odst. 4 (Retailové bankovnictví)** |  |  |  |  |  |
| 0090 | **ASA podle čl. 314 odst. 4 (Komerční bankovnictví)** |  |  |  |  |  |
| 0100 | **Doplňková položka**: ILDC ve vztahu k jednotlivé instituci / konsolidované skupině (včetně subjektů uvedených v čl. 314 odst. 3) |  |  |  |  |  |
| **Další informace** | | | | | | |
| 0110 | **Přístup použitý pro výpočet finanční složky** |  |  |  |  |  |

„C 16.02 – OPERAČNÍ RIZIKO – Složka obchodního ukazatele (OPR BIC)“

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **C 16.02 – OPERAČNÍ RIZIKO – Složka obchodního ukazatele (OPR BIC)** | | | | | | | | |
|  |  |  | |  |  |  |  |  |
|  | | **ROK –3** | | **ROK –2** | | **LOŇSKÝ ROK** | |  |
|  |
| **Účetní hodnota** | **Hodnota – přístup obezřetnostní hranice** | **Účetní hodnota** | **Hodnota – přístup obezřetnostní hranice** | **Účetní hodnota** | **Hodnota – přístup obezřetnostní hranice** | **Průměrná hodnota** |  |
| 0010 | 0020 | 0030 | 0040 | 0050 | 0060 | 0070 |  |
| **0010–0210** | **1. Úroková, leasingová a dividendová složka (ILDC)** | | | | | | |  |  |
| 0010 | **Úroková složka** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0020 | **Čisté výnosy** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0030 | **Úrokové výnosy (včetně výnosů z pronajatých aktiv (finanční a operativní leasing))** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0040 | Úrokové výnosy |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0050 | Výnosy z pronajatých aktiv (finanční a operativní leasing) jiné než úrokové výnosy |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0060 | Zisky z pronajatých aktiv (finanční a operativní leasing) |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0070 | **Úrokové náklady (včetně nákladů na pronajatá aktiva (finanční a operativní leasing))** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0080 | (Úrokové náklady) |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0090 | (Náklady na aktiva pronajatá v rámci operativního leasingu jiné než úrokové náklady) |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0100 | (Ztráty z aktiv pronajatých v rámci operativního leasingu) |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0110 | **Složka aktiv** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0120 | **Aktiva celkem** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0130 | Hotovost u centrálních bank a ostatní vklady na požádání |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0140 | Dluhové cenné papíry |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0150 | Úvěry a zálohy |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0160 | Deriváty |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0170 | Obchodovatelné a ekonomické zajištění |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0180 | Zajišťovací účetnictví |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0190 | Aktiva v leasingu |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0200 | **Dividendová složka** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0210 | Výnosy z dividend |  |  |  |  |  |  |  |  |
| **0220–0360** | **2. Složka služeb** | | | | | | | |  |
| 0220 | **Ostatní provozní výnosy** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0230 | Ostatní provozní výnosy od členů patřících do téhož institucionálního systému ochrany |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0240 | Zisk z dlouhodobých aktiv a vyřazovaných skupin, které jsou klasifikovány jako určené k prodeji a nesplňují podmínky pro ukončované činnosti |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0250 | Ostatní |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0260 | **(Ostatní provozní náklady)** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0270 | (Ostatní provozní náklady vyplacené členům patřícím do téhož institucionálního systému ochrany) |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0280 | (Celkové ztráty, náklady, rezervy a jiné finanční dopady v důsledku událostí operačního rizika) |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0290 | (Ztráty z dlouhodobých aktiv a vyřazovaných skupin, které jsou klasifikovány jako určené k prodeji a nesplňují podmínky pro ukončované činnosti) |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0300 | (Ostatní) |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0310 | **Složka výnosů z poplatků a provizí** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0320 | Výnosy z poplatků a provizí |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0330 | Z toho: od členů patřících do téhož institucionálního systému ochrany |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0340 | **(Složka nákladů na poplatky a provize)** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0350 | (Náklady na poplatky a provize) |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0360 | (Z toho: vyplacené členům patřícím do téhož institucionálního systému ochrany |  |  |  |  |  |  |  |  |
| **0370–0480** | **3. Finanční složka** | | | | | | | |  |
| 0370 | **Složka obchodního portfolia** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0380 | **Čistý zisk nebo (–) ztráta vztahující se na obchodní portfolio** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0390 | Čisté zisky nebo (–) ztráty z finančních aktiv a závazků určených k obchodování nebo z obchodování finančních aktiv a závazků |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0400 | Obchodní portfolio – Čisté zisky nebo (–) ztráty ze zajišťovacího účetnictví |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0410 | Obchodní portfolio – Čisté kurzové rozdíly [zisk nebo (–) ztráta] |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0420 | **Složka investičního portfolia** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0430 | **Čistý zisk nebo (–) ztráta vztahující se na investiční portfolio** |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0440 | Čisté zisky nebo (–) ztráty z odúčtování finančních aktiv a závazků neoceňovaných reálnou hodnotou do zisku nebo ztráty |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0450 | Čisté zisky nebo (-) ztráty z neobchodních finančních aktiv povinně oceňovaných reálnou hodnotou do zisku nebo ztráty |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0460 | Čisté zisky nebo (–) ztráty z finančních aktiv a závazků oceňovaných reálnou hodnotou do zisku nebo ztráty |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0470 | Investiční portfolio – Čisté zisky nebo (–) ztráty ze zajišťovacího účetnictví |  |  |  |  |  |  |  |  |
| 0480 | Investiční portfolio – Čisté kurzové rozdíly [zisk nebo (–) ztráta] |  |  |  |  |  |  |  |  |

„C 16.03 – ROZČLENĚNÍ OPERAČNÍHO RIZIKA (OPR BD) – Ztráty, náklady, rezervy a jiné finanční dopady vyplývající z událostí operačního rizika“

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **C 16.03 – ROZČLENĚNÍ OPERAČNÍHO RIZIKA (OPR BD) – Ztráty, náklady, rezervy a jiné finanční dopady vyplývající z událostí operačního rizika** | | | | |
|  | | **Účetní hodnota** | | |
| **ROK –3** | **ROK –2** | **LOŇSKÝ ROK** |
|  |
| 0010 | 0020 | 0030 |  |
| **0010–0080** | **Ztráty, náklady, rezervy a jiné finanční dopady v důsledku událostí operačního rizika:** |  |  |  |  |
| 0010 | (Úrokové náklady) |  |  |  |  |
| 0020 | (Ostatní provozní náklady) |  |  |  |  |
| 0030 | (Správní náklady) |  |  |  |  |
| 0040 | (Odpisy v důsledku událostí operačního rizika) |  |  |  |  |
| 0050 | (Rezervy nebo (–) reverzace rezerv) |  |  |  |  |
| 0060 | (Znehodnocení nebo (–) reverzace ztráty ze znehodnocení) |  |  |  |  |
| 0070 | (Ostatní) |  |  |  |  |
| 0080 | **(Celkem)** |  |  |  |  |

„C 16.04 – OPERAČNÍ RIZIKO – Informace o dceřiných společnostech, na něž se vztahuje čl. 314 odst. 3 nařízení o kapitálových požadavcích“

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **C 16.04 – OPERAČNÍ RIZIKO – Informace o dceřiných společnostech, na něž se vztahuje čl. 314 odst. 3 nařízení o kapitálových požadavcích** | | | | | | |  |
|  | | | | | | |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | **Název právnické osoby** | **Kód LEI** | **ILDC** | **IC** | **AC** | **DC** |  |
|  |
|  |
| Řádky | 0010 | 0020 | 0030 | 0040 | 0050 | 0060 |  |
| … |  |  |  |  |  |  |  |