

Metodický list

Cenné papíry v držení bank (bez ČNB)

I. Definice a obsah

Údaje o cenných papírech v držení bank (bez ČNB) v členění podle vybraných sektorů emitentů, druhu cenných papírů, původní splatnosti a měn.

a) Souhrnně podle sektoru emitenta – všechny měny

Celkový objem držených cenných papírů souhrnně za všechny měny členěný podle druhu cenného papíru (neobchodovatelné, ostatní dluhové, majetkové), rezidentské příslušnosti emitenta a podle vybraného sektoru emitenta.

b) Souhrnně podle sektoru emitenta – CZK

Celkový objem držených cenných papírů v CZK členěný podle druhu cenného papíru (neobchodovatelné, ostatní dluhové, majetkové), rezidentské příslušnosti emitenta a podle vybraného sektoru emitenta.

c) Ostatní dluhové cenné papíry podle splatnosti a sektoru emitenta – všechny měny

Celkový objem držených ostatních dluhových cenných papírů souhrnně za všechny měny členěný podle doby splatnosti (do 1 roku, 1-5 let, nad 5 let), rezidentské příslušnosti emitenta a podle vybraného sektoru emitenta.

II. Zdroje a metodika zjišťování

Zdrojem dat pro sestavení jsou výkazy „VST (ČNB) 21-12 - Měsíční výkaz o cenných papírech a účástech držených bankou“ (pro časové řady do 31.12.2008 včetně) a „VST (ČNB) 41-12 - Měsíční přehled cenných papírů v držení banky“ (pro časové řady od 31.1.2009) předkládané bankami a pobočkami zahraničních bank působícími v ČR pravidelně vždy k poslednímu dni každého měsíce.

III. Členění

Sektor emitenta – v souladu s klasifikací ekonomických sektorů a subsektorů podle ESA 2010:

- Rezidenti a nerezidenti celkem
 - Rezidenti celkem
 - z toho:
 - Nefinanční podniky (S.11)
 - Centrální banka a obchodní banky (S.121 + část S.122 banky)
 - Pojišťovací společnosti a penzijní fondy (S.128 + S.129)
 - Vládní instituce (S.13)
 - Nerezidenti celkem

Druh cenného papíru

- Neobchodovatelné cenné papíry – směnky a ostatní dluhové cenné papíry, které nejsou přijaty k obchodování na tuzemském nebo zahraničním veřejném trhu a nejsou ani běžně obchodovány OTC (over-the-counter); do roku 2003 směnky a cenné papíry pořízené bankou v primárních emisích a neurčené k obchodování
- Ostatní dluhové cenné papíry – kupónové i bezkupónové dluhopisy, hypotéční zástavní listy atd.
- Majetkové cenné papíry a podíly (včetně FPT) – majetkové podíly (představované i nepředstavované cennými papíry) včetně akcií a podílových listů fondů peněžního trhu

Poznámka: Celková hodnota dluhových cenných papírů se získá součtem neobchodovatelných a ostatních dluhových cenných papírů. V harmonizované měnové statistice jsou neobchodovatelné cenné papíry v držení řazeny do poskytnutých úvěrů.

Měna – prioritně se sleduje měna, ve kterém byl cenný papír emitován

- Všechny měny souhrnně
z toho:
 - CZK

Splatnost – členění podle původní doby splatnosti cenného papíru

- Intervaly splatnosti ostatních dluhových cenných papírů:
 - do 1 roku včetně,
 - nad 1 rok do 5 let včetně (do roku 2003 do 4 let včetně),
 - nad 5 let (do roku 2003 nad 4 roky).

IV. Způsob výpočtu

Údaje jsou agregovány za všechny subjekty. Výstupní členění jsou výsledkem načítání původních podrobně členěných údajů od bank.

V. Změna metodiky

Údaje zahrnují pouze komerční banky. Do roku 2003 včetně je nejvyšší hranice splatnosti ostatních dluhových cenných papírů 4 roky namísto 5 let. Od roku 2004 obsahují emitované neobchodovatelné cenné papíry kromě směnek namísto cenných papírů nakoupených v primárních emisích další dluhové cenné papíry, které nelze běžně obchodovat (neexistuje trh, nebo na něm nejsou obchodovány, omezená převoditelnost atd.). Do roku 2013 bylo uveřejňováno sektorové členění emitentů odpovídající klasifikaci ESA 95.

VI. Vykazující subjekty

Vykazujícími subjekty jsou banky a pobočky zahraničních bank působící v ČR.

Seznam bank se v čase mění s tím, jak banky vznikají a zanikají. V každém období údaje odpovídají souboru bank existujících v daném období, tj. souboru subjektů s platnou bankovní licencí. Údaje nejsou zpětně upravovány tak, aby korespondovaly s aktuálním souborem bank. Aktuální i historické údaje o seznamu bank jsou k dispozici na www stránkách ČNB (<http://www.cnb.cz/>).