

B0413

ZOBOWIĄZANIA POZABILANSOWE - WAGA RYZYKA KONTRAHENTA 0% Cz. I

		stan na dzień w tys. zł		
		Kwota		Równoważnik kredytowy
		Metoda zaangażowania pierwotnego	Metoda wyceny rynkowej	
A1	1. Waga ryzyka produktu 0% (ryzyko niskie)	A1	A2	B1
B1	a) niewykorzystane udzielone zobowiązania kredytowe z terminem pierwotnym do 1 roku lub z możliwością bezwarunkowego wypowiedzenia			
C1	b) transakcje sprzedaży opcji			
D1	2. Waga ryzyka produktu 20% (ryzyko niskośrednie)			
E1	a) akredytywy dokumentowe, dla których zabezpieczenie stanowi wysłany towar			
F1	b) inne udzielone zobowiązania wygasające z chwilą realizacji transakcji będącej ich podstawą			
G1	3. Waga ryzyka produktu 50% (ryzyko średnie)			
H1	a) akredytywy dokumentowe otwarte i akredytywy dokumentowe potwierdzone			
I1	b) udzielone gwarancje jakości i inne, nieodwołalne promesy udzielenia akredytywy - nie będące substytutem kredytu			
J1	c) niewykorzystane udzielone zobowiązania kredytowe z terminem pierwotnym powyżej 1 roku			
K1	4. Waga ryzyka produktu 100% (ryzyko pełne)			
L1	a) udzielone gwarancje mające charakter substytutu kredytu			
M1	b) udzielone akcepty			
N1	c) udzielone poleczenia wekslowe			
O1	d) udzielone zobowiązania z tytułu transakcji z prawem zwrotu przedmiotu transakcji			
P1	e) nieodwołalne promesy udzielenia akredytywy mające charakter substytutu kredytu			
Q1	f) umowy sprzedaży z przyrzeczeniem odkupu, ujęte jako kategorie pozabilansowe			
S1	g) depozyty terminowe z przyszłym terminem rozpoczęcia okresu depozytu			
T1	h) nieopłacona część akcji i papierów wartościowych			
U1	i) pozostałe udzielone zobowiązania pozabilansowe			

B0414

ZOBOWIĄZANIA POZABILANSOWE - WAGA RYZYKA KONTRAHENTA 0% Cz. II

stan na dzień w tys. zł			
	Kwota		Równoważnik kredytowy
	Metoda zaangażowania pierwotnego	Metoda wyceny rynkowej	
	A1	A2	
B1			B1
5. Transakcje terminowe i transakcje opcyjne			
a) transakcje stopy procentowej:			
C1	≤ 14 dni		
D1	> 14 dni i ≤ 3 miesiące		
E1	> 3 miesięcy i ≤ 1 roku		
F1	> 1 rok		
b) transakcje walutowe:			
H1	≤ 14 dni		
I1	> 14 dni i ≤ 3 miesiące		
J1	> 3 miesięcy i ≤ 1 roku		
K1	> 1 rok		
c) transakcje ceny złota:			
L1	≤ 14 dni		
M1	> 14 dni i ≤ 3 miesiące		
N1	> 3 miesięcy i ≤ 1 roku		
P1	> 1 rok		
d) inne transakcje :			
R1	≤ 14 dni		
S1	> 14 dni i ≤ 3 miesiące		
T1	> 3 miesięcy i ≤ 1 roku		
U1	> 1 rok		

B0415

ZOBOWIĄZANIA POZABILANSOWE - WAGA RYZYKA KONTRAHENTA 20% Cz. I

		stan na dzień w tys. zł		
		Kwota		Równoważnik kredytowy
A1		A1	A2	B1
1. Waga ryzyka produktu 0% (ryzyko niskie)				
B1	a) niewykorzystane udzielone zobowiązania kredytowe z terminem pierwotnym do 1 roku lub z możliwością bezwartunkowego wypowiedzenia			
C1	b) transakcje sprzedaży opcji			
2. Waga ryzyka produktu 20% (ryzyko niskośrednie)				
D1	a) akredytywy dokumentowe, dla których zabezpieczenie stanowi wysłany towar			
E1	b) inne udzielone zobowiązania wygasające z chwilą realizacji transakcji będącej ich podstawą			
F1				
3. Waga ryzyka produktu 50% (ryzyko średnie)				
G1	a) akredytywy dokumentowe otwarte i akredytywy dokumentowe potwierdzone			
H1	b) udzielone gwarancje jakości i inne, nieodwołalne promesy udzielenia akredytywy - nie będące substytutem kredytu			
I1	c) niewykorzystane udzielone zobowiązania kredytowe z terminem pierwotnym powyżej 1 roku			
4. Waga ryzyka produktu 100% (ryzyko pełne)				
K1	a) udzielone gwarancje mające charakter substytutu kredytu			
L1	b) udzielone akcepty			
M1	c) udzielone poręczenia wekslowe			
N1	d) udzielone zobowiązania z tytułu transakcji z prawem zwrotu przedmiotu transakcji			
O1	e) nieodwołalne promesy udzielenia akredytywy mające charakter substytutu kredytu			
P1	f) umowy sprzedaży z przyrzeczeniem odkupu, ujęte jako kategorie pozabilansowe			
Q1	g) depozyty terminowe z przyszłym terminem rozpoczęcia okresu depozytu			
S1	h) nieopłacona część akcji i papierów wartościowych			
T1	i) pozostałe udzielone zobowiązania pozabilansowe			
U1				

B0416

ZOBOWIĄZANIA POZABILANSOWE - WAGA RYZYKA KONTRAHENTA 20% Cz. II

		stan na dzień		w tys. zł
		Kwota		
		Metoda zaangażowania pierwotnego	Metoda wyceny rynkowej	
		A1	A2	
				Równoważnik kredytowy
A1	5. Transakcje terminowe i transakcje opcyjne			B1
B1	a) transakcje stopy procentowej:			
C1	≤ 14 dni			
D1	> 14 dni i ≤ 3 miesiące			
E1	> 3 miesięcy i ≤ 1 roku			
F1	> 1 rok			
G1	b) transakcje walutowe:			
H1	≤ 14 dni			
I1	> 14 dni i ≤ 3 miesiące			
J1	> 3 miesięcy i ≤ 1 roku			
K1	> 1 rok			
L1	c) transakcje ceny złota:			
M1	≤ 14 dni			
N1	> 14 dni i ≤ 3 miesiące			
O1	> 3 miesięcy i ≤ 1 roku			
P1	> 1 rok			
Q1	d) inne transakcje :			
R1	≤ 14 dni			
S1	> 14 dni i ≤ 3 miesiące			
T1	> 3 miesięcy i ≤ 1 roku			
U1	> 1 rok			

ZOBOWIĄZANIA POZABILANSOWE - WAGA RYZYKA KONTRAHENTA 50%

stan na dzień w tys. zł				
		Kwota		Równoważnik kredytowy
		Metoda zaangażowania pierwotnego	Metoda wyceny rynkowej	
		A1	A2	
A1	5. Transakcje terminowe i transakcje opcyjne			
B1	a) transakcje stopy procentowej:			
C1	≤ 14 dni			
D1	> 14 dni i ≤ 3 miesiące			
E1	> 3 miesięcy i ≤ 1 roku			
F1	> 1 rok			
G1	b) transakcje walutowe:			
H1	≤ 14 dni			
I1	> 14 dni i ≤ 3 miesiące			
J1	> 3 miesięcy i ≤ 1 roku			
K1	> 1 rok			
L1	c) transakcje ceny złota:			
M1	≤ 14 dni			
N1	> 14 dni i ≤ 3 miesiące			
O1	> 3 miesięcy i ≤ 1 roku			
P1	> 1 rok			
Q1	d) inne transakcje :			
R1	≤ 14 dni			
S1	> 14 dni i ≤ 3 miesiące			
T1	> 3 miesięcy i ≤ 1 roku			
U1	> 1 rok			

B0418

ZOBOWIĄZANIA POZABILANSOWE - WAGA RYZYKA KONTRAHENTA 100%

stan na dzień w tys. zł		Kwota	Równoważnik kredytowy
		A1	B1
A1	1. Waga ryzyka produktu 0% (ryzyko niskie)		
B1	a) niewykorzystane udzielone zobowiązania kredytowe z terminem pierwotnym do 1 roku lub z możliwością bezwarunkowego wypowiedzenia		
C1	b) transakcje sprzedaży opcji		
D1	2. Waga ryzyka produktu 20% (ryzyko niskośrednie)		
E1	a) akredytywy dokumentowe, dla których zabezpieczenie stanowi wysłany towar		
F1	b) inne udzielone zobowiązania wygasające z chwilą realizacji transakcji będącej ich podstawą		
G1	3. Waga ryzyka produktu 50% (ryzyko średnie)		
H1	a) akredytywy dokumentowe otwarte i akredytywy dokumentowe potwierdzone		
I1	b) udzielone gwarancje jakości i inne, nieodwołalne promesy udzielenia akredytywy - nie będące substytutem kredytu		
J1	c) niewykorzystane udzielone zobowiązania kredytowe z terminem pierwotnym powyżej 1 roku		
K1	4. Waga ryzyka produktu 100% (ryzyko pełne)		
L1	a) udzielone gwarancje mające charakter substytutu kredytu		
M1	b) udzielone akcepty		
N1	c) udzielone polecenia wekslowe		
O1	d) udzielone zobowiązania z tytułu transakcji z prawem zwrotu przedmiotu transakcji		
P1	e) nieodwołalne promesy udzielenia akredytywy mające charakter substytutu kredytu		
Q1	f) umowy sprzedaży z przyrzeczeniem odkupu, ujęte jako kategorie pozabilansowe		
S1	g) depozyty terminowe z przyszłym terminem rozpoczęcia okresu depozytu		
T1	h) nieopłacona część akcji i papierów wartościowych		
U1	i) pozostałe udzielone zobowiązania pozabilansowe		

B0503

LOKATY MIĘDZYBANKOWE POWYŻEJ 3 MIESIĘCY

(z wyłączeniem NBP)

stan na dzień w tys. zł

[illegible]

