

M0008

**STAN PORTFELA WŁASNEGO OBLIGACJI SKARBOWYCH
WYEMITOWANYCH PRZEZ REZYDENTA, NOMINOWANYCH W PLN I WALUTACH OBCYCH
WG WARTOŚCI NOMINALNEJ**

stan na dzień.....w tys. zł

		Nominowane w PLN	Nominowane w EUR	Nominowane w innych walutach
		A1	B1	C1
A1	1.Obligacje skarbowe			

M0009

OBROTY NA RYNKU NIEZABEZPIECZONYCH DEPOZYTÓW MIĘDZYBANKOWYCH ORAZ NA RYNKU OPERACJI WARUNKOWYCH (REPO, REVERSE REPO, BSB i SBB) ZABEZPIECZONYCH INSTRUMENTAMI DŁUŻNYMI WG TERMINÓW PIERWOTNYCH TYCH TRANSAKCJI

informacja w okresie.....w tys zł

		Niezabezpieczone depozyty międzybankowe złożone	Niezabezpieczone depozyty międzybankowe przyjęte	Operacje repo i reverse repo zawarte z MIF	Operacje BSB i SBB zawarte z MIF	Operacje repo i reverse repo zawarte z instytucjami niemonetarnymi (podmiotami innymi niż MIF)	Operacje BSB i SBB zawarte z instytucjami niemonetarnymi (podmiotami innymi niż MIF)
		A1	B1	C1	D1	E1	F1
A1	z terminem pierwotnym: O/N						
B1	inne jednodniowe (T/N, S/N)						
C1	do 1 tygodnia włącznie (bez jednodniowych)						
D1	powyżej 1 tygodnia do 1 miesiąca włącznie						
E1	powyżej 1 do 3 miesięcy włącznie						
F1	powyżej 3 do 6 miesięcy włącznie						
G1	powyżej 6 miesięcy i do 1 roku włącznie						
H1	powyżej 1 roku						
I1	Razem						

M0010

**OBROTY NA RYNKU OPERACJI WARUNKOWYCH
REPO, REVERSE REPO ZABEZPIECZONYCH INSTRUMENTAMI DŁUŻNYMI WG KATEGORII KONTRAHENTA**

informacja w okresie.....w tys. zł

		REPO				REVERSE REPO			
		Bony pieniężne NBP	Bony skarbowe	Obligacje skarbowe	Pozostałe instrumenty dłużne	Bony pieniężne NBP	Bony skarbowe	Obligacje skarbowe	Pozostałe instrumenty dłużne
		A1	B1	C1	D1	E1	F1	G1	H1
A1	1. Instytucje krajowe								
B1	Monetarne instytucje finansowe								
C1	w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych								
D1	Instytucje ubezpieczeniowe	x				x			
E1	Fundusze emerytalne	x				x			
F1	Pozostałe instytucje pośrednictwa finansowego i pomocnicze instytucje finansowe	x				x			
G1	w tym - fundusze inwestycyjne	x				x			
H1	Przedsiębiorstwa	x				x			
I1	Gospodarstwa domowe i instytucje niekomercyjne działające na rzecz gospodarstw domowych	x				x			
J1	Instytucje rządowe i samorządowe	x				x			
K1	2. Instytucje krajów UGiW i reszty świata	x				x			

M0011

**OBROTY NA RYNKU OPERACJI WARUNKOWYCH
SELL-BUY-BACK, BUY-SELL-BACK ZABEZPIECZONYCH INSTRUMENTAMI DŁUŻNYMI WG KATEGORII KONTRAHENTA**

informacja w okresie.....w tys. zł

	SELL-BUY-BACK				BUY-SELL-BACK			
	Bony pieniężne NBP	Bony skarbowe	Obligacje skarbowe	Pozostałe instrumenty dłużne	Bony pieniężne NBP	Bony skarbowe	Obligacje skarbowe	Pozostałe instrumenty dłużne
	A1	B1	C1	D1	E1	F1	G1	H1
A1	1. Instytucje krajowe							
B1	Monetarne instytucje finansowe							
C1	w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
D1	Instytucje ubezpieczeniowe							
E1	Fundusze emerytalne							
F1	Pozostałe instytucje pośrednictwa finansowego i pomocnicze instytucje finansowe							
G1	w tym - fundusze inwestycyjne							
H1	Przedsiębiorstwa							
I1	Gospodarstwa domowe i instytucje niekomercyjne działające na rzecz gospodarstw domowych							
J1	Instytucje rządowe i samorządowe							
K1	2. Instytucje krajów UGIW i reszty świata							

M0012

OBROTY NA KRAJOWYM RYNKU POZAGIEŁDOWYCH INSTRUMENTÓW POCHODNYCH Cz. I

WG WARTOŚCI NOMINALNEJ

informacja w okresie.....w tys. zł

Rodzaj instrumentu pochodnego		Kontrakty/opcje zakupione	Kontrakty/opcje sprzedane
		A1	B1
A1	Kontrakty IRS		
B1	Zawarte z instytucjami krajowymi		
B5	w tym - z monetarnymi instytucjami finansowymi		
B7	w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych		
C1	Zawarte z instytucjami krajów UGiW i reszty świata		
C5	w tym - z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami		
D1	Kontrakty OIS		
E1	Zawarte z instytucjami krajowymi		
E5	w tym - z monetarnymi instytucjami finansowymi		
E7	w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych		
F1	Zawarte z instytucjami krajów UGiW i reszty świata		
F5	w tym - z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami		
G1	Kontrakty FRA		
H1	Zawarte z instytucjami krajowymi		
H5	w tym - z monetarnymi instytucjami finansowymi		
H7	w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych		
I1	Zawarte z instytucjami krajów UGiW i reszty świata		
I5	w tym - z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami		
J1	Kontrakty CIRS		
K1	Zawarte z instytucjami krajowymi		
K5	w tym - z monetarnymi instytucjami finansowymi		
K7	w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych		
L1	Zawarte z instytucjami krajów UGiW i reszty świata		
L5	w tym - z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami		
M1	Opcje na stopy procentowe		
N1	Zawarte z instytucjami krajowymi		
N5	w tym - z monetarnymi instytucjami finansowymi		
N7	w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych		
O1	Zawarte z instytucjami krajów UGiW i reszty świata		
O5	w tym - z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami		

M0013

OBROTY NA KRAJOWYM RYNKU POZAGIEŁDOWYCH INSTRUMENTÓW POCHODNYCH Cz.II

WG WARTOSCI NOMINALNEJ

informacja w okresie.....w tys. zł

Rodzaj instrumentu pochodnego		zakupione		sprzedane	
		opcje put	opcje call	opcje put	opcje call
		A1	B1	C1	D1
A1	1. Opcje walutowe na kurs USD/PLN				
B1	Zawarte z instytucjami krajowymi				
C1	w tym - z monetarnymi instytucjami finansowymi				
D1	w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych				
E1	Zawarte z instytucjami krajów UGiW i reszty świata				
F1	w tym - z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami				
G1	2. Opcje walutowe na kurs EUR/PLN				
H1	Zawarte z instytucjami krajowymi				
I1	w tym - z monetarnymi instytucjami finansowymi				
J1	w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych				
K1	Zawarte z instytucjami krajów UGiW i reszty świata				
L1	w tym - z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami				

M0014

**STRUKTURA TERMINOWA OBROTÓW NA RYNKU POZAGIEŁDOWYCH
INSTRUMENTÓW POCHODNYCH - KONTRAKTY IRS i CIRS
WG WARTOŚCI NOMINALNEJ INSTRUMENTÓW**

informacja w okresie.....w tys. zł

		Kontrakty IRS	Kontrakty CIRS
		A1	B1
A1	z terminem pierwotnym do 1 roku włącznie		
B1	powyżej 1 roku do 2 lat włącznie		
C1	powyżej 2 lat do 3 lat włącznie		
D1	powyżej 3 lat do 5 lat włącznie		
E1	powyżej 5 lat do 10 lat włącznie		
F1	powyżej 10 lat		
G1	Razem		

M0015

**STRUKTURA TERMINOWA OBROTÓW NA RYNKU POZAGIEŁDOWYCH
INSTRUMENTÓW POCHODNYCH - KONTRAKTY OIS,
OPCJE WALUTOWE (EUR/PLN, USD/PLN) I OPCJE NA STOPE PROCENTOWĄ
WG WARTOŚCI NOMINALNEJ INSTRUMENTÓW**

informacja w okresie.....w tys. zł

		Kontrakty OIS		Opcje na kurs USD/PLN		Opcje na kurs EUR/PLN		Opcje na stopę procentową
		WIBOR	POLONIA	opcje put	opcje call	opcje put	opcje call	
		A1	B1	C1	D1	E1	F1	
A1	z terminem pierwotnym do 1 miesiąca włącznie							
B1	w tym - do 1 tygodnia włącznie			x	x	x	x	x
C1	powyżej 1 do 3 miesięcy włącznie							
D1	powyżej 3 do 6 miesięcy włącznie							
E1	powyżej 6 do 9 miesięcy włącznie							
F1	powyżej 9 miesięcy do 1 roku włącznie							
G1	powyżej 1 roku							
H1	Razem							

M0016

**STRUKTURA TERMINOWA OBROTÓW NA RYNKU POZAGIEŁDOWYCH
INSTRUMENTÓW POCHODNYCH - KONTRAKTY FRA**

WG WARTOŚCI NOMINALNEJ INSTRUMENTÓW

informacja w okresie.....w tys. zł

		Kontrakty FRA
		A1
A1	Rodzaj kontraktu:	1x2
B1		2x3
C1		1x4
D1		2x5
E1		3x6
F1		6x9
G1		9x12
H1		12x15
I1		1x7
J1		2x8
K1		3x9
L1		6x12
M1		12x18
N1	pozostałe z terminem pierwotnym do 1 roku włącznie	
O1	z terminem pierwotnym powyżej 1 roku	
P1	Razem	

M0017

OBROTY NA RYNKU WALUTOWYM - WARTOŚĆ TRANSAKCJI ZAWARTYCH PRZEZ PODMIOT SPRAWOZDAJĄCY

informacja w okresie.....w tys. zł

TYP TRANSAKCJI / termin pierwotny		WALUTA OBCA - WALUTA OBCA			WALUTA OBCA - PLN		
		OGÓŁEM	w tym:		OGÓŁEM	w tym:	
			EUR/USD	EUR/inne waluty		USD/inne waluty	EUR/PLN
A1	B1	C1	D1	E1	F1	G1	
A1	Natychmiastowe SPOT						
B1	Zawarte z instytucjami krajowymi						
B5	w tym: z monetarnymi instytucjami finansowymi						
B7	w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych						
C1	Zawarte z instytucjami krajów UGiW i reszty świata						
C5	w tym: z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami						
D1	Outright forward						
E1	Zawarte z instytucjami krajowymi						
E5	w tym : z monetarnymi instytucjami finansowymi						
E7	w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych						
F1	Zawarte z instytucjami krajów UGiW i reszty świata						
F5	w tym: z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami						
G1	FX swap						
H1	Zawarte z instytucjami krajowymi						
H5	w tym: z monetarnymi instytucjami finansowymi						
H7	w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych						
I1	Zawarte z instytucjami krajów UGiW i reszty świata						
I5	w tym : z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami						
J1	Terminy pierwotne transakcji outright forward						
K1	Do 1 tygodnia włącznie						
L1	Powyżej 1 tygodnia do 1 miesiąca włącznie						
M1	Powyżej 1 do 3 miesięcy włącznie						
N1	Powyżej 3 miesięcy do 1 roku włącznie						
O1	Powyżej 1 roku						
P1	Terminy pierwotne transakcji fx swap						
Q1	Do 1 tygodnia włącznie						
R1	Powyżej 1 tygodnia do 1 miesiąca włącznie						
S1	Powyżej 1 do 3 miesięcy włącznie						
T1	Powyżej 3 miesięcy do 1 roku włącznie						
U1	Powyżej 1 roku						