

**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			

M0010

## OBROTY NA RYNKU OPERACJI WARUNKOWYCH REPO, REVERSE REPO ZABEZPIECZONYCH INSTRUMENTAMI DŁUŻNYMI

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	
<b>1. Instytucje krajowe</b>										
B1										
C1										
D1	x					x				
E1	x					x				
F1										
G1	x					x				
H1	x					x				
I1	x					x				
J1	x					x				
K1	x					x				
L1										
M1										
M3										
N1										
N3										
O1										
O3										
P1										
P3										
Q1										
Q3										
R1										
R3										
S1										
S3										
T1	x	x				x	x			
T3	x	x				x	x			

M0011

## OBROTY NA RYNKU OPERACJI WARUNKOWYCH SELL-BUY-BACK, BUY-SELL-BACK ZABEZPIECZONYCH INSTRUMENTAMI DŁUŻNYMI

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	x	B1	C1	D1	E1	F1	G1	H1
<b>1. Instytucje krajowe</b>								
B1								
C1								
D1	x				x			
E1	x				x			
F1								
G1	x				x			
H1	x				x			
I1	x				x			
J1	x				x			
K1	x				x			
L1								
M1								
M3								
N1								
N3								
O1								
O3								
P1								
P3								
Q1								
Q3								
R1								
R3								
S1								
S3								
T1	x	x			x	x		
T3	x	x			x	x		

M0012  
OBROTY NA KRAJOWYM RYNKU POZAGIELDOWYCH INSTRUMENTÓW POCHODNYCH Cz.I

WG WARTOŚCI NOMINALNEJ

Rodzaj instrumentu pochodnego		Kontrakty/opcje zakupione	Kontrakty/opcje sprzedane
		A1	B1
A1	<b>Kontrakty IRS</b>		
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	<b>Kontrakty OIS</b>		
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	<b>Kontrakty FRA</b>		
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		
J2	<b>Kontrakty CIRS (bez Currency Basis Swap)</b>		
K2	Zawarte z instytucjami krajowymi		
K6	w tym - z monetarnymi instytucjami finansowymi		
K8	w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych		
L2	Zawarte z instytucjami krajów UGIW i reszty świata		
L6	w tym - z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami		
M1	<b>Opcje na stopy procentowe</b>		
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		
P1	<b>Kontrakty Currency Basis Swap</b>		
R1	Zawarte z instytucjami krajowymi		
R5	w tym - z monetarnymi instytucjami finansowymi		
R7	w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych		
S1	Zawarte z instytucjami krajów UGIW i reszty świata		
S5	w tym - z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami		

informacja w okresie.....w tys. zł

M0014

**STRUKTURA TERMINOWA OBROTÓW NA RYNKU POZAGIEŁDOWYCH  
INSTRUMENTÓW POCODNYCH - KONTRAKTY IRS  
WG WARTOŚCI NOMINALNEJ INSTRUMENTÓW**

		informacja w okresie.....w tys. zł
		Kontrakty IRS
		A1
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	<b>Razem</b>	

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 pieniężnym do 1 miesiąca włącznie						
B1	w tym - do 1 tygodnia włącznie						
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	<b>Razem</b>						

**M0016**  
**STRUKTURA TERMINOWA OBROTÓW NA RYNKU POZAGIEŁDOWYCH**  
**INSTRUMENTÓW POCODNYCH - KONTRAKTY FRA**

**WG WARTOŚCI NOMINALNEJ INSTRUMENTÓW**

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

M0018

## OBROTY NA RYNKU WALUTOWYM – WARTOŚĆ TRANSAKCJI ZAWARTYCH PRZEZ PODMIOT SPRAWOZDAJĄCY W OBSZARZE WALUTA OBCA – PLN CZ. I

informacja w okresie.....w tys. zł

	TYP TRANSAKCJI / termin pierwotny	WALUTA OBCA – PLN						pozostałe waluty obce – PLN
		OGÓLEM	zakupione	sprzedane	EUR/PLN	USD/PLN	CHF/PLN	
		A1	A2	A3	B1	C1	D1	
A1	<b>Natychniastowe SPOT</b>							
B1	Zawarte z instytucjami krajowymi							
B5	w tym: – z monetarnymi instytucjami finansowymi							
B7	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
B8	– z pozostałymi instytucjami sektora finansowego							
C1	Zawarte z instytucjami krajów UGIW i reszty świata							
C5	w tym: – z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami							
C7	– z pozostałymi instytucjami sektora finansowego							
D1	<b>Outright forward</b>							
E1	Zawarte z instytucjami krajowymi							
E5	w tym: – z monetarnymi instytucjami finansowymi							
E7	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
E8	– z pozostałymi instytucjami sektora finansowego							
F1	Zawarte z instytucjami krajów UGIW i reszty świata							
F5	w tym: – z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami							
F7	– z pozostałymi instytucjami sektora finansowego							
G1	<b>FX swap</b>							
H1	Zawarte z instytucjami krajowymi							
H5	w tym: – z monetarnymi instytucjami finansowymi							
H7	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
H8	– z pozostałymi instytucjami sektora finansowego							
I1	Zawarte z instytucjami krajów UGIW i reszty świata							
I5	w tym: – z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami							
I7	– z pozostałymi instytucjami sektora finansowego							



M0018

## OBROTY NA RYNKU WALUTOWYM – WARTOŚĆ TRANSAKCJI ZAWARTYCH PRZEZ PODMIOT SPRAWOZDAJĄCY W OBSZARZE WALUTA OBCA – PLN CZ. II

informacja w okresie.....w tys. zł

	TYP TRANSAKCJI / termin pierwotny	WALUTA OBCA – PLN					CHF/PLN	pozostałe waluty obce – PLN
		OGÓLEM	zakupione	sprzedane	EUR/PLN	USD/PLN		
J1	<b>Terminy pierwotne transakcji outright forward</b>	A1	A2	A3	B1	C1	D1	E1
K1	Do 1 tygodnia włącznie							
K3	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
L1	Powyżej 1 tygodnia do 1 miesiąca włącznie							
L3	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
M1	Powyżej 1 do 3 miesięcy włącznie							
M3	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
N1	Powyżej 3 miesięcy do 1 roku włącznie							
N3	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
O1	Powyżej 1 roku							
O3	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
P1	<b>Terminy pierwotne transakcji FX swap</b>							
Q1	Do 1 tygodnia włącznie							
Q3	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
R1	Powyżej 1 tygodnia do 1 miesiąca włącznie							
R3	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
S1	Powyżej 1 do 3 miesięcy włącznie							
S3	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
T1	Powyżej 3 miesięcy do 1 roku włącznie							
T3	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
U1	Powyżej 1 roku							
U3	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							

M0018

## OBROTY NA RYNKU WALUTOWYM – WARTOŚĆ TRANSAKCJI ZAWARTYCH PRZEZ PODMIOT SPRAWOZDAJĄCY W OBSZARZE WALUTA OBCA – PLN CZ. III

informacja w okresie.....w tys. zł

	TYP TRANSAKCJI / termin pierwotny	WALUTA OBCA – PLN						pozostałe waluty obce – PLN E1
		OGÓLEM A1	zakupione A2	sprzedane A3	EUR/PLN B1	USD/PLN C1	CHF/PLN D1	
V1	<b>Kontrakty CIRS (bez Currency Basis Swap)</b>							
V2	Zawarte z instytucjami krajowymi							
V3	w tym: – z monetarnymi instytucjami finansowymi							
V4	w tym: – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
VA	– z pozostałymi instytucjami sektora finansowego							
VB	Zawarte z instytucjami krajów UGiW i reszty świata							
VC	w tym: – z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami							
VD	– z pozostałymi instytucjami sektora finansowego							
W1	<b>Terminy pierwotne kontraktów CIRS (bez Currency Basis Swap)</b>							
W2	Do 1 roku włącznie							
WA	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
WB	Powyżej 1 roku do 2 lat włącznie							
WC	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
WD	Powyżej 2 lat do 3 lat włącznie							
WE	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
WF	Powyżej 3 lat do 5 lat włącznie							
WG	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
WH	Powyżej 5 lat do 10 lat włącznie							
WI	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
WJ	Powyżej 10 lat							
WK	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							

M0018

## OBROTY NA RYNKU WALUTOWYM – WARTOŚĆ TRANSAKCJI ZAWARTYCH PRZEZ PODMIOT SPRAWOZDAJĄCY W OBSZARZE WALUTA OBCA – PLN CZ. IV

informacja w okresie.....w tys. zł

TYP TRANSAKCJI / termin pierwotny		WALUTA OBCA – PLN						pozostałe waluty obce – PLN
		OGÓŁEM	zakupione	sprzedane	EUR/PLN	USD/PLN	CHF/PLN	
		A1	A2	A3	B1	C1	D1	E1
X1	<b>Kontrakty Currency Basis Swap</b>							
X2	Zawarte z instytucjami krajowymi							
X3	w tym: – z monetarnymi instytucjami finansowymi							
X4	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
XA	– z pozostałymi instytucjami sektora finansowego							
XB	Zawarte z instytucjami krajów UGIW i reszty świata							
XC	w tym: – z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami							
XD	– z pozostałymi instytucjami sektora finansowego							
Y1	<b>Terminy pierwotne kontraktów Currency Basis Swap</b>							
Y2	Do 1 roku włącznie							
YA	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
YB	Powyżej 1 roku do 2 lat włącznie							
YC	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
YD	Powyżej 2 lat do 3 lat włącznie							
YE	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
YF	Powyżej 3 lat do 5 lat włącznie							
YG	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
YH	Powyżej 5 lat do 10 lat włącznie							
YI	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
YJ	Powyżej 10 lat							
YK	w tym – banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							