

**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	<b>Razem</b>						

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	<b>1. Instytucje krajowe</b>								
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	<b>2. Instytucje krajów UGiW i reszty świata</b>	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	<b>1. Instytucje krajowe</b>								
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	<b>2. Instytucje krajów UGIW i reszty świata</b>	X				X			

M0014

**STRUKTURA TERMINOWA OBROTÓW NA RYNKU POZAGIEŁDOWYCH  
INSTRUMENTÓW POCHODNYCH - 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 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	<b>Razem</b>							

**M0016**

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

**WG WARTOŚCI NOMINALNEJ INSTRUMENTÓW**

informacja w okresie.....w tys. zł

		<b>Kontrakty FRA</b>	
		A1	
A1	<b>Rodzaj kontraktu:</b>	<b>1x2</b>	
B1		<b>2x3</b>	
C1		<b>1x4</b>	
D1		<b>2x5</b>	
E1		<b>3x6</b>	
F1		<b>6x9</b>	
G1		<b>9x12</b>	
H1		<b>12x15</b>	
I1		<b>1x7</b>	
J1		<b>2x8</b>	
K1		<b>3x9</b>	
L1		<b>6x12</b>	
M1		<b>12x18</b>	
N1	<b>pozostałe z terminem pierwotnym do 1 roku włącznie</b>		
O1	<b>z terminem pierwotnym powyżej 1 roku</b>		
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				
		OGÓLEM	EUR/PLN	USD/PLN	CHF/PLN	pozostałe waluty obce-PLN
		A1	B1	C1	D1	E1
<b>A1</b>	<b>Natychmiastowe 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					
C1	Zawarte z instytucjami krajów UGiW i reszty świata					
C5	w tym: z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami					
<b>D1</b>	<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					
F1	Zawarte z instytucjami krajów UGiW i reszty świata					
F5	w tym: z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami					
<b>G1</b>	<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					
I1	Zawarte z instytucjami krajów UGiW i reszty świata					
I5	w tym : z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami					
<b>J1</b>	<b>Terminy pierwotne transakcji outright forward</b>					
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					
<b>P1</b>	<b>Terminy pierwotne transakcji FX swap</b>					
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					



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				
	OGÓŁEM	EUR/PLN	USD/PLN	CHF/PLN	pozostałe waluty obce-PLN
	A1	B1	C1	D1	E1
<b>V1</b> <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					
V5 Zawarte z instytucjami krajów UGIW i reszty świata					
V6 w tym : z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami					
<b>W1</b> <b>Terminy pierwotne kontraktów CIRS (bez Currency Basis Swap)</b>					
W2 Do 1 roku włącznie					
W3 Powyżej 1 roku do 2 lat włącznie					
W4 Powyżej 2 lat do 3 lat włącznie					
W5 Powyżej 3 lat do 5 lat włącznie					
W6 Powyżej 5 lat do 10 lat włącznie					
W7 Powyżej 10 lat					
<b>X1</b> <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					
X5 Zawarte z instytucjami krajów UGIW i reszty świata					
X6 w tym : z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami					
<b>Y1</b> <b>Terminy pierwotne kontraktów Currency Basis Swap</b>					
Y2 Do 1 roku włącznie					
Y3 Powyżej 1 roku do 2 lat włącznie					
Y4 Powyżej 2 lat do 3 lat włącznie					
Y5 Powyżej 3 lat do 5 lat włącznie					
Y6 Powyżej 5 lat do 10 lat włącznie					
Y7 Powyżej 10 lat					