

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

	REPO				REVERSE REPO				informacja w okresie				
	Bony pieniężne NBP	Bony skarbowe	Obligacje skarbowe	Pozostałe instrumenty dłużne	Bony pieniężne NBP	Bony skarbowe	Obligacje skarbowe	Pozostałe instrumenty dłużne	Bony pieniężne NBP	Bony skarbowe	Obligacje skarbowe	Pozostałe instrumenty dłużne	w tys. zł
A1		B1	C1	D1	E1	F1	G1	H1					
A1													
B1													
C1													
D1	x				x								
E1	x				x								
F1													
G1	x				x								
H1	x				x								
I1	x				x								
J1	x				x								
K12	x				x								
L1													
M1													
M3													
N1													
N3													
O1													
O3													
P1													
P3													
Q1													
Q3													
R1													
R3													
S1													
S3													
T1	x	x			x								
T3	x	x			x								

¹⁾ oraz instytucje finansowe typu captive i udzielające pożyczek

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	Bony skarbowe	Obligacje skarbowe	Pozostałe instrumenty dłużne
A1	B1	C1	D1	E1	F1	G1	H1				
A11. Instytucje krajowe											
B1 Monetarne instytucje finansowe											
C1 w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych											
D1 Instytucje ubezpieczeniowe	x										
E1 Fundusze emerytalne	x										
F1 Fundusze inwestycyjne niebędące funduszami rynku pieniężnego oraz pozostałe instytucje pośrednictwa finansowego ¹⁾ i pomocnicze instytucje finansowe	x										
G1 w tym - fundusze inwestycyjne niebędące funduszami rynku pieniężnego	x										
H1 Przedsiębiorstwa	x										
I1 Gospodarstwa domowe i instytucje niekomercyjne działające na rzecz gospodarstw domowych	x										
J1 Instytucje rządowe i samorządowe	x										
K1.2. Instytucje krajów UGiW i reszty świata	x										
L1 Terminy pieniężne transakcji SELL-BUY-BACK, BUY-SELL-BACK											
M1 ON											
M3 w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych											
N1 inne jednostki (TN, SN)											
N3 w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych											
O1 do 1 tygodnia włącznie (bez jednodniowych)											
O3 w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych											
P1 powyżej 1 tygodnia do 1 miesiąca włącznie											
P3 w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych											
Q1 powyżej 1 do 3 miesięcy włącznie											
Q3 w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych											
R1 powyżej 3 do 6 miesięcy włącznie											
R3 w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych											
S1 powyżej 6 miesięcy do 1 roku włącznie											
S3 w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych											
T1 powyżej 1 roku	x										
T3 w tym - banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych	x										

¹⁾ oraz instytucje finansowe typu captive i udzielające pożyczek

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	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		
J2	Kontrakty CIRS (bez Currency Basis Swap)		
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	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		
P1	Kontrakty Currency Basis Swap		
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	z terminem pierwotnym do 1 roku włącznie	A1
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 STOPĘ 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	opcje put	opcje call		
A1	B1	C1	D1	E1	F1	G1				
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	Razem									

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

WG WARTOŚCI NOMINALNEJ INSTRUMENTÓW

		informacja w okresie.....w tys. zł
		Kontrakty FRA
A1	Rodzaj kontraktu:	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	Razem	

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

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	Kontrakty CIRS (bez Currency Basis Swap)							
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	Terminy pierwotne kontraktów CIRS (bez Currency Basis Swap)							
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						
		OGÓŁEM	zakupione	sprzedane	EUR/PLN	USD/PLN	CHF/PLN	pozostałe waluty obce – PLN
		A1	A2	A3	B1	C1	D1	E1
X1	Kontrakty Currency Basis Swap							
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	Terminy pierwotne kontraktów Currency Basis Swap							
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							