

D0003	
Deklaracja sprawozdawcza – lista formularzy	
	TAK/NIE
DE070 Nabywcy nieskarbowych dłużnych papierów wartościowych (stan rachunków papierów wartościowych)	
DE090 Obroty na rynku niezabezpieczonych depozytów międzybankowych oraz na rynku operacji warunkowych (repo, reverse repo, BSB i SBB) zabezpieczonych instrumentami dłużnymi według terminów pierwotnych tych transakcji	
DE100 Obroty na rynku operacji outright	
DE110 Obroty na rynku operacji warunkowych repo, reverse repo zabezpieczonych instrumentami dłużnymi	
DE120 Struktura terminowa obrotów na rynku operacji warunkowych repo, reverse repo zabezpieczonych instrumentami dłużnymi	
DE121 Obroty na rynku operacji warunkowych repo/reverse repo zawartych na elektronicznym rynku skarbowych papierów wartościowych i centralnie rozliczonych według terminów pierwotnych tych transakcji	
DE130 Obroty na rynku operacji warunkowych sell-buy-back, buy-sell-back zabezpieczonych instrumentami dłużnymi	
DE140 Struktura terminowa obrotów na rynku operacji warunkowych sell-buy-back, buy-sell-back zabezpieczonych instrumentami dłużnymi	
DE150 Obroty na krajowym rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych według wartości nominalnej część I	
DE160 Obroty na krajowym rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych według wartości nominalnej część II	
DE170 Struktura terminowa obrotów na krajowym rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych – transakcje IRS według wartości nominalnej	
DE180 Struktura terminowa obrotów na krajowym rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych – transakcje OIS, opcje walutowe i opcje na stopę procentową według wartości nominalnej	
DE190 Struktura terminowa obrotów na krajowym rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych – transakcje FRA według wartości nominalnej	
DE200 Obroty na rynku walutowym – wartość transakcji zawartych w segmencie waluta obca – waluta obca	
DE210 Struktura terminowa obrotów na rynku walutowym – wartość transakcji outright forward i FX swap zawartych w segmencie waluta obca – waluta obca	
DE220 Struktura terminowa obrotów na rynku walutowym – wartość transakcji Currency Basis Swap i Currency Interest Rate Swap zawartych w segmencie waluta obca – waluta obca	
DE230 Obroty na rynku walutowym – wartość transakcji zawartych w segmencie waluta obca – PLN	
DE240 Struktura terminowa obrotów na rynku walutowym – wartość transakcji outright forward i FX swap zawartych w segmencie waluta obca – PLN	
DE250 Struktura terminowa obrotów na rynku walutowym – wartość transakcji Currency Basis Swap i Currency Interest Rate Swap zawartych w segmencie waluta obca – PLN	

DE150					
Obroty na krajowym rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych według wartości nominalnej część I					
dane miesięczne					
informacje w okresie w tys. PLN					
	PLN			EUR	Inne waluty
	Ogółem	Transakcje kupna/ opcje zakupione	Transakcje sprzedaży/ opcje sprzedane	Ogółem	Ogółem
1. Transakcje IRS					
1.1. Zawarte z instytucjami krajowymi					
w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP				
	transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo				
	z monetarnymi instytucjami finansowymi				
	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych				
	z pozostałymi instytucjami finansowymi				
1.2. Zawarte z instytucjami krajów strefy euro i reszty świata					
w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP				
	transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo				
	z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami				
	z pozostałymi instytucjami finansowymi				
2. Transakcje OIS					
2.1. Zawarte z instytucjami krajowymi					
w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP				
	transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo				
	z monetarnymi instytucjami finansowymi				
	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych				
	z pozostałymi instytucjami finansowymi				
2.2. Zawarte z instytucjami krajów strefy euro i reszty świata					
w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP				
	transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo				
	z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami				
	z pozostałymi instytucjami finansowymi				
3. Transakcje FRA					
3.1. Zawarte z instytucjami krajowymi					
w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP				
	transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo				
	z monetarnymi instytucjami finansowymi				
	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych				
	z pozostałymi instytucjami finansowymi				
3.2. Zawarte z instytucjami krajów strefy euro i reszty świata					
w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP				
	transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo				
	z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami				
	z pozostałymi instytucjami finansowymi				
4. Opcje na stopę procentową					
4.1. Zawarte z instytucjami krajowymi					
w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP				
	transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo				
	z monetarnymi instytucjami finansowymi				
	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych				
	z pozostałymi instytucjami finansowymi				
4.2. Zawarte z instytucjami krajów strefy euro i reszty świata					
w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP				
	transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo				
	z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami				
	z pozostałymi instytucjami finansowymi				

DE160					
Obroty na krajowym rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych według wartości nominalnej część II					
dane miesięczne					
informacje w okresie w tys. PLN					
	Ogółem	zakupione		sprzedane	
		opcje put	opcje call	opcje put	opcje call
1. Opcje walutowe – waluta obca/PLN					
1.1. Zawarte z instytucjami krajowymi					
transakcje przekazane do rozliczenia w CCP					
transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo					
z monetarnymi instytucjami finansowymi					
w tym: banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych					
w tym: w tym: transakcje zawarte na księgę podmiotu dominującego z siedzibą za granicą					
z pozostałymi instytucjami finansowymi					
1.2. Zawarte z instytucjami krajów strefy euro i reszty świata					
transakcje przekazane do rozliczenia w CCP					
transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo					
z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami					
z pozostałymi instytucjami finansowymi					
2. Opcje walutowe na kurs USD/PLN					
2.1. Zawarte z instytucjami krajowymi					
transakcje przekazane do rozliczenia w CCP					
transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo					
z monetarnymi instytucjami finansowymi					
w tym: banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych					
w tym: w tym: transakcje zawarte na księgę podmiotu dominującego z siedzibą za granicą					
z pozostałymi instytucjami finansowymi					
2.2. Zawarte z instytucjami krajów strefy euro i reszty świata					
transakcje przekazane do rozliczenia w CCP					
transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo					
z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami					
z pozostałymi instytucjami finansowymi					
3. Opcje walutowe na kurs EUR/PLN					
3.1. Zawarte z instytucjami krajowymi					
transakcje przekazane do rozliczenia w CCP					
transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo					
z monetarnymi instytucjami finansowymi					
w tym: banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych					
w tym: w tym: transakcje zawarte na księgę podmiotu dominującego z siedzibą za granicą					
z pozostałymi instytucjami finansowymi					
3.2. Zawarte z instytucjami krajów strefy euro i reszty świata					
transakcje przekazane do rozliczenia w CCP					
transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo					
z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami					
z pozostałymi instytucjami finansowymi					

DE180

Struktura terminowa obrotów na krajowym rynku pozagiełdowych instrumentów pochodnych – transakcje OIS, opcje walutowe i opcje na stopę procentową według wartości nominalnej

Dane miesięczne

informacje w okresie w tys. PLN

			Transakcje OIS				Opcje walutowe – waluta obca/PLN						Opcje na stopę procentową
							opcje put	opcje call	Opcje na kurs USD/PLN		Opcje na kurs EUR/PLN		
			WIBOR	POLONIA	POLSTR	WIRON			opcje put	opcje call	opcje put	opcje call	
Razem terminy pierwotne:													
do 1 miesiąca włącznie	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych												
	w tym:	do 1 tygodnia włącznie					X	X	X	X	X	X	X
	w tym	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych					X	X	X	X	X	X	X
powyżej 1 miesiąca do 3 miesięcy włącznie	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych												
	w tym	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych											
powyżej 3 miesięcy do 6 miesięcy włącznie	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych												
	w tym	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych											
powyżej 6 miesięcy do 9 miesięcy włącznie	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych												
	w tym	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych											
powyżej 9 miesięcy do 1 roku włącznie	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych												
	w tym	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych											
powyżej 1 roku	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych												
	w tym	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych											

DE200									
Obroty na rynku walutowym – wartość transakcji zawartych w segmencie waluta obca – waluta obca									
dane miesięczne									
informacje w okresie w tys. PLN									
				WALUTA OBCA – WALUTA OBCA					
				EUR/USD	EUR/CHF	EUR/inne waluty	USD/CHF	USD/inne waluty	pozostałe pary walut obcych
1. Natychmiastowe SPOT									
1.1. Zawarte z instytucjami krajowymi									
w tym:	w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP							
		transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo							
		z monetarnymi instytucjami finansowymi							
		w tym:	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych						
			transakcje zawarte na księgę podmiotu dominującego z siedzibą za granicą						
		z pozostałymi instytucjami finansowymi							
1.2. Zawarte z instytucjami krajów strefy euro i reszty świata									
w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP								
	transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo								
	z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami								
	z pozostałymi instytucjami finansowymi								
2. Outright forward									
2.1. Zawarte z instytucjami krajowymi									
w tym:	w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP							
		transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo							
		z monetarnymi instytucjami finansowymi							
		w tym:	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych						
			transakcje zawarte na księgę podmiotu dominującego z siedzibą za granicą						
		z pozostałymi instytucjami finansowymi							
2.2. Zawarte z instytucjami krajów strefy euro i reszty świata									
w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP								
	transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo								
	z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami								
	z pozostałymi instytucjami finansowymi								
3. FX swap									
3.1. Zawarte z instytucjami krajowymi									
w tym:	w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP							
		transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo							
		z monetarnymi instytucjami finansowymi							
		w tym:	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych						
			transakcje zawarte na księgę podmiotu dominującego z siedzibą za granicą						
		z pozostałymi instytucjami finansowymi							
3.2. Zawarte z instytucjami krajów strefy euro i reszty świata									
w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP								
	transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo								
	z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami								
	z pozostałymi instytucjami finansowymi								
4. Transakcje Currency Basis Swap									
4.1. Zawarte z instytucjami krajowymi									
w tym:	w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP							
		transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo							
		z monetarnymi instytucjami finansowymi							
		w tym:	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych						
			transakcje zawarte na księgę podmiotu dominującego z siedzibą za granicą						
		z pozostałymi instytucjami finansowymi							
4.2. Zawarte z instytucjami krajów strefy euro i reszty świata									
w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP								
	transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo								
	z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami								
	z pozostałymi instytucjami finansowymi								
5. Transakcje Currency Interest Rate Swap (bez Currency Basis Swap)									
5.1. Zawarte z instytucjami krajowymi									
w tym:	w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP							
		transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo							
		z monetarnymi instytucjami finansowymi							
		w tym:	banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych						
			transakcje zawarte na księgę podmiotu dominującego z siedzibą za granicą						
		z pozostałymi instytucjami finansowymi							
5.2. Zawarte z instytucjami krajów strefy euro i reszty świata									
w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP								
	transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo								
	z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami								
	z pozostałymi instytucjami finansowymi								

Obroty na rynku walutowym – wartość transakcji zawartych w segmencie waluta obca – PLN

informacje w okresie w tys. PLN

				WALUTA OBCA – PLN					
				zakupione	sprzedane	EUR/PLN	USD/PLN	CHF/PLN	pozostałe waluty obce – PLN
1. Natychmiastowe SPOT									
1.1. Zawarte z instytucjami krajowymi									
w tym:	w tym	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP							
		transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo z monetarnymi instytucjami finansowymi							
		banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
			transakcje zawarte na księgę podmiotu dominującego z siedzibą za granicą						
		z pozostałymi instytucjami finansowymi							
1.2. Zawarte z instytucjami krajów strefy euro i reszty świata									
w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP								
	transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami								
	z pozostałymi instytucjami finansowymi								
2. Outright forward									
2.1. Zawarte z instytucjami krajowymi									
w tym:	w tym	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP							
		transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo z monetarnymi instytucjami finansowymi							
		banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
			transakcje zawarte na księgę podmiotu dominującego z siedzibą za granicą						
		z pozostałymi instytucjami finansowymi							
2.2. Zawarte z instytucjami krajów strefy euro i reszty świata									
w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP								
	transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami								
	z pozostałymi instytucjami finansowymi								
3. FX swap									
3.1. Zawarte z instytucjami krajowymi									
w tym:	w tym	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP							
		transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo z monetarnymi instytucjami finansowymi							
		banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
			transakcje zawarte na księgę podmiotu dominującego z siedzibą za granicą						
		z pozostałymi instytucjami finansowymi							
3.2. Zawarte z instytucjami krajów strefy euro i reszty świata									
w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP								
	transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami								
	z pozostałymi instytucjami finansowymi								
4. Transakcje Currency Basis Swap									
4.1. Zawarte z instytucjami krajowymi									
w tym:	w tym	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP							
		transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo z monetarnymi instytucjami finansowymi							
		banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
			transakcje zawarte na księgę podmiotu dominującego z siedzibą za granicą						
		z pozostałymi instytucjami finansowymi							
4.2. Zawarte z instytucjami krajów strefy euro i reszty świata									
w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP								
	transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami								
	z pozostałymi instytucjami finansowymi								
5. Transakcje Currency Interest Rate Swap (bez Currency Basis Swap)									
5.1. Zawarte z instytucjami krajowymi									
w tym:	w tym	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP							
		transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo z monetarnymi instytucjami finansowymi							
		banki krajowe, oddziały instytucji kredytowych oraz oddziały banków zagranicznych							
			transakcje zawarte na księgę podmiotu dominującego z siedzibą za granicą						
		z pozostałymi instytucjami finansowymi							
5.2. Zawarte z instytucjami krajów strefy euro i reszty świata									
w tym:	transakcje przekazane do rozliczenia w CCP								
	transakcje z podmiotami powiązanymi kapitałowo z monetarnymi instytucjami finansowymi/bankami								
	z pozostałymi instytucjami finansowymi								