

Zakres danych niezbędnych do oceny aktywności banków

Wszystkie banki, które w roku bieżącym zgłosiły deklarację zamiaru kandydowania do pełnienia funkcji DRP w 2011 roku, zobowiązane są do przekazywania do NBP miesięcznych danych o:

I. Wartości transakcji zawartych na rynku pochodnych stopy procentowej OIS z terminem zapadalności do 1 roku, dla których stawką referencyjną jest stopa POLONIA.

Przekazuje się informację o sumie wartości nominalnych (kwot bazowych) kontraktów zakupionych i sprzedanych przez kandydata na rynku międzybankowym w okresie sprawozdawczym..

Jeśli transakcje między dealerami instytucji sprawozdającej oraz z podmiotami z tej samej grupy kapitałowej (podmiotami dominującymi, stowarzyszonymi, spółkami zależnymi, oddziałami) zostały zawarte jedynie w celu uproszczenia zapisów księgowych lub ułatwienia zarządzania ryzykiem w określonej instytucji, należy je wykluczyć z raportowania.

mln PLN

Wartość nominalna

II. Wartości transakcji zawartych na rynku FX swap z udziałem PLN z tytułu transakcji o terminie zapadalności do 1 roku.

Przekazuje się informację o sumie płatności rozumianych jako wymiana kwot podstawowych, zawieranych na rynku międzybankowym w okresie sprawozdawczym.

mln PLN

Wartość nominalna

Osoba odpowiedzialna za sporządzanie i terminowe dostarczanie informacji miesięcznej do Departamentu Operacji Krajowych Narodowego Banku Polskiego.

Imię i nazwisko:

Funkcja:

Departament:

tel. fax.:

Pieczętka i podpis

Informacje prosimy przysyłać w terminie do 8 dnia kalendarzowego następującego po każdym miesiącu sprawozdawczym - **poczawszy od sprawozdania za listopad 2009 r.** za pośrednictwem faxu na nr: 022- 826-67-50 lub na adres:

Narodowy Bank Polski

Departament Operacji Krajowych

ul. Świętokrzyska 11/21

00-919 Warszawa

Banki kandydujące, z wyjątkiem banków pełniących funkcję DRP, powinny przesyłać do NBP miesięczne dane o:

I. Stanie obligacji skarbowych wyemitowanych przez rezydenta (nominowanych w PLN i walutach obcych) posiadanych przez Bank w portfelu własnym w ostatnim dniu miesiąca sprawozdawczego.

Wartość papierów w walutach obcych przelicza się po kursie średnim NBP z ostatniego dnia miesiąca sprawozdawczego.

mln PLN

Wartość nominalna

II. Transakcjach warunkowych zabezpieczonych bonami pieniężnymi NBP i obligacjami skarbowymi wyemitowanymi na podstawie prawa polskiego.

Przekazuje się informacje o sumie transakcji REPO/REVERSE REPO oraz SELL-BUY BACK/BUY-SELL-BACK według wartości nominalnej papierów wartościowych, będących zabezpieczeniem tych transakcji (z wyłączeniem operacji dokonanych z NBP) rozpoczętych (i już zakończonych, jak i nie zakończonych) w okresie sprawozdawczym.

mln PLN

Repo	Reverse repo	Sell-Buy-Back	Buy-Sell-Back

III. O obrotach na rynku pozagieldowych instrumentów pochodnych - IRS, FRA z terminem zapadalności do 1 roku.

Przekazuje się informacje tylko o sumie kontraktów, zawartych w okresie sprawozdawczym, których kwota nominalna transakcji jest wyrażona w PLN.

w mln PLN

Rodzaj kontraktu	Wartość nominalna
IRS	
FRA	

Osoba odpowiedzialna za sporządzanie i terminowe dostarczanie informacji miesięcznej do Departamentu Operacji Krajowych Narodowego Banku Polskiego.

Imię i nazwisko:
tel. fax.:

Funkcja:
Pieczęć i podpis

Departament:

Informacje prosimy przesyłać w terminie do 8 dnia kalendarzowego następującego po każdym miesiącu sprawozdawczym - **począwszy od sprawozdania za listopad 2009 r.** za pośrednictwem faxu na nr: 022- 826-67-50 lub na adres:

Narodowy Bank Polski
Departament Operacji Krajowych
ul. Świętokrzyska 11/21
00-919 Warszawa