

## 08\_01 Členění derivátů podle podkladového aktiva

| Popis   | CR | Celkem<br>(hodnota<br>podkladového<br>aktiva) | Splatnost do<br>1 roku<br>(hodnota<br>podkladového<br>aktiva) | Splatnost 1<br>rok až 5let<br>(hodnota<br>podkladového<br>aktiva) | Splatnost nad<br>5 let (hodnota<br>podkladového<br>aktiva) |
|---|----|---|---|---|--|
| A   | B  | 1   | 2   | 3   | 4  |
| <b>1. Opce</b>  | 01 |   |   |   |  |
| a) Call opce  | 02 |   |   |   |  |
| i) Call opce nakoupené  | 03 |   |   |   |  |
| - akciové   | 04 |   |   |   |  |
| - <i>podkladové aktivum je<br/>    registrováno na regulovaném<br/>    nebo obdobném trhu</i> | 05 |   |   |   |  |
| - <i>ostatní</i>  | 06 |   |   |   |  |
| - úrokové   | 07 |   |   |   |  |
| - <i>podkladové aktivum je<br/>    registrováno na regulovaném<br/>    nebo obdobném trhu</i> | 08 |   |   |   |  |
| - <i>ostatní</i>  | 09 |   |   |   |  |
| - měnové  | 10 |   |   |   |  |
| - komoditní   | 11 |   |   |   |  |
| - úvěrové   | 12 |   |   |   |  |
| - jiné  | 13 |   |   |   |  |
| ii) Call opce prodané   | 14 |   |   |   |  |
| - akciové   | 15 |   |   |   |  |
| - <i>podkladové aktivum je<br/>    registrováno na regulovaném<br/>    nebo obdobném trhu</i> | 16 |   |   |   |  |
| - <i>ostatní</i>  | 17 |   |   |   |  |
| - úrokové   | 18 |   |   |   |  |
| - <i>podkladové aktivum je<br/>    registrováno na regulovaném<br/>    nebo obdobném trhu</i> | 19 |   |   |   |  |
| - <i>ostatní</i>  | 20 |   |   |   |  |
| - měnové  | 21 |   |   |   |  |
| - komoditní   | 22 |   |   |   |  |
| - úvěrové   | 23 |   |   |   |  |
| - jiné  | 24 |   |   |   |  |
| b) Put opce   | 25 |   |   |   |  |
| i) Put opce nakoupené   | 26 |   |   |   |  |
| - akciové   | 27 |   |   |   |  |
| - <i>podkladové aktivum je<br/>    registrováno na regulovaném<br/>    nebo obdobném trhu</i> | 28 |   |   |   |  |
| - <i>ostatní</i>  | 29 |   |   |   |  |
| - úrokové   | 30 |   |   |   |  |
| - <i>podkladové aktivum je<br/>    registrováno na regulovaném<br/>    nebo obdobném trhu</i> | 31 |   |   |   |  |

|  |           |  |  |  |  |
|--|-----------|--|--|--|--|
| - ostatní  | 32        |  |  |  |  |
| - měnové   | 33        |  |  |  |  |
| - komoditní  | 34        |  |  |  |  |
| - úvěrové  | 35        |  |  |  |  |
| - jiné   | 36        |  |  |  |  |
| ii) Put opce prodané   | 37        |  |  |  |  |
| - akciové  | 38        |  |  |  |  |
| - podkladové aktivum je<br>registrováno na regulovaném<br>nebo obdobném trhu | 39        |  |  |  |  |
| - ostatní  | 40        |  |  |  |  |
| - úrokové  | 41        |  |  |  |  |
| - podkladové aktivum je<br>registrováno na regulovaném<br>nebo obdobném trhu | 42        |  |  |  |  |
| - ostatní  | 43        |  |  |  |  |
| - měnové   | 44        |  |  |  |  |
| - komoditní  | 45        |  |  |  |  |
| - úvěrové  | 46        |  |  |  |  |
| - jiné   | 47        |  |  |  |  |
| <b>2. Pevné termínové kontrakty</b>  | <b>48</b> |  |  |  |  |
| <b>Futures</b>   | <b>49</b> |  |  |  |  |
| - akciové  | 50        |  |  |  |  |
| - podkladové aktivum je<br>registrováno na regulovaném<br>nebo obdobném trhu | 51        |  |  |  |  |
| - ostatní  | 52        |  |  |  |  |
| - úrokové  | 53        |  |  |  |  |
| - podkladové aktivum je<br>registrováno na regulovaném<br>nebo obdobném trhu | 54        |  |  |  |  |
| - ostatní  | 55        |  |  |  |  |
| - měnové   | 56        |  |  |  |  |
| - komoditní  | 57        |  |  |  |  |
| - úvěrové  | 58        |  |  |  |  |
| - jiné   | 59        |  |  |  |  |
| <b>Forwardy</b>  | <b>60</b> |  |  |  |  |
| - akciové  | 61        |  |  |  |  |
| - podkladové aktivum je<br>registrováno na regulovaném<br>nebo obdobném trhu | 62        |  |  |  |  |
| - ostatní  | 63        |  |  |  |  |
| - úrokové  | 64        |  |  |  |  |
| - podkladové aktivum je<br>registrováno na regulovaném<br>nebo obdobném trhu | 65        |  |  |  |  |
| - ostatní  | 66        |  |  |  |  |
| - měnové   | 67        |  |  |  |  |
| - komoditní  | 68        |  |  |  |  |
| - úvěrové  | 69        |  |  |  |  |
| - jiné   | 70        |  |  |  |  |
| <b>Swapy</b>   | <b>71</b> |  |  |  |  |

|   |    |  |  |  |  |
|---|----|--|--|--|--|
| - akciové   | 72 |  |  |  |  |
| - <i>podkladové aktivum je registrováno na regulovaném nebo obdobném trhu</i>   | 73 |  |  |  |  |
| - <i>ostatní</i>  | 74 |  |  |  |  |
| - úrokové   | 75 |  |  |  |  |
| - <i>podkladové aktivum je registrováno na regulovaném nebo obdobném trhu</i>   | 76 |  |  |  |  |
| - <i>ostatní</i>  | 77 |  |  |  |  |
| - měnové  | 78 |  |  |  |  |
| - komoditní   | 79 |  |  |  |  |
| - úvěrové   | 80 |  |  |  |  |
| - jiné  | 81 |  |  |  |  |
| <b>3. Jiné investiční nástroje, ze kterých vyplývá právo na vypořádání v penězích a jejichž hodnota se odvozuje zejména z kurzu podkladového aktiva</b> | 82 |  |  |  |  |
| - akciové   | 83 |  |  |  |  |
| - úrokové   | 84 |  |  |  |  |
| - měnové  | 85 |  |  |  |  |
| - komoditní   | 86 |  |  |  |  |
| - úvěrové   | 87 |  |  |  |  |
| - jiné  | 88 |  |  |  |  |