Το κείμενο αυτό αποτελεί απλώς εργαλείο τεκμηρίωσης και δεν έχει καμία νομική ισχύ. Τα θεσμικά όργανα της Ένωσης δεν φέρουν καμία ευθύνη για το περιεχόμενό του. Τα αυθεντικά κείμενα των σχετικών πράξεων, συμπεριλαμβανομένων των προοιμίων τους, είναι εκείνα που δημοσιεύονται στην Επίσημη Εφημερίδα της Ευρωπαϊκής Ένωσης και είναι διαθέσιμα στο EUR-Lex. Αυτά τα επίσημα κείμενα είναι άμεσα προσβάσιμα μέσω των συνδέσμων που περιέχονται στο παρόν έγγραφο

►B **ΚΑΤ' ΕΞΟΥΣΙΟΔΟΤΗΣΗ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ (ΕΕ) 2017/583 ΤΗΣ ΕΠΙΤΡΟΠΗΣ**

της 14ης Ιουλίου 2016

σχετικά με τη συμπλήρωση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου για τις αγορές χρηματοπιστωτικών μέσων όσον αφορά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα για τις απαιτήσεις διαφάνειας για τους τόπους διαπραγμάτευσης και τις επιχειρήσεις επενδύσεων ως προς τις ομολογίες, τα δομημένα χρηματοπιστωτικά προϊόντα, τα δικαιώματα εκπομπής και τα παράγωγα

(Κείμενο που παρουσιάζει ενδιαφέρον για τον ΕΟΧ)

(ΕΕ L 87 της 31.3.2017, σ. 229)

Διορθώνεται από:

►C1 Διορθωτικό ΕΕ L 276 της 26.10.2017, σ. 78 (2017/583)

▼B

ΚΑΤ' ΕΞΟΥΣΙΟΔΟΤΗΣΗ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ (ΕΕ) 2017/583 ΤΗΣ ΕΠΙΤΡΟΠΗΣ

της 14ης Ιουλίου 2016

σχετικά με τη συμπλήρωση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου για τις αγορές χρηματοπιστωτικών μέσων όσον αφορά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα για τις απαιτήσεις διαφάνειας για τους τόπους διαπραγμάτευσης και τις επιχειρήσεις επενδύσεων ως προς τις ομολογίες, τα δομημένα χρηματοπιστωτικά προϊόντα, τα δικαιώματα εκπομπής και τα παράγωγα

(Κείμενο που παρουσιάζει ενδιαφέρον για τον ΕΟΧ)

ΚΕΦΑΛΑΙΟ Ι

ΟΡΙΣΜΟΙ

Άρθρο 1

Ορισμοί

Για τους σκοπούς του παρόντος κανονισμού, ισχύουν οι ακόλουθοι ορισμοί:

1) Ως «συναλλαγή πακέτου» νοείται μία από τις ακόλουθες:

   α) μια συναλλαγή σε μια σύμβαση παραγώγων ή άλλου χρηματοπιστωτικού μέσου που εξαρτάται από την ταυτόχρονη εκτέλεση συναλλαγής σε ισοδύναμη ποσότητα ενός υποκείμενου υλικού περιουσιακού στοιχείου (ανταλλαγή με φυσικές παραδόσεις ή ΑΦΠ)·

   β) μια συναλλαγή η οποία αφορά την εκτέλεση δύο ή περισσότερων συναλλαγών στοιχείων σε χρηματοπιστωτικά μέσα και:

      i) η οποία εκτελείται μεταξύ δύο ή περισσότερων αντισυμβαλλομένων·

      ii) όπου κάθε στοιχείο της συναλλαγής ενέχει ουσιαστικό οικονομικό ή δημοσιονομικό κίνδυνο ο οποίος σχετίζεται με όλα τα υπόλοιπα στοιχεία·

      iii) όπου η εκτέλεση κάθε στοιχείου είναι ταυτόχρονη και εξαρτάται από την εκτέλεση όλων των υπόλοιπων στοιχείων.

2) Ως «σύστημα αίτησης προσδιορισμού τιμής» νοείται ένα σύστημα διαπραγμάτευσης σε σχέση με το οποίο πληρούνται οι ακόλουθες προϋποθέσεις:

   α) παρέχεται προσδιορισμός ή προσδιορισμοί τιμής από ένα μέλος ή συμμετέχοντα ως απάντηση σε ένα αίτημα για ζεύγος εντολών που υποβάλλεται από ένα ή περισσότερα άλλα μέλη ή συμμετέχοντες·

   β) το ζεύγος εντολών είναι εκτελέσιμο αποκλειστικά από το μέλος ή τον συμμετέχοντα που υποβάλλει το αίτημα·

   γ) το μέλος ή ο συμμετέχων της αγοράς που υποβάλλει το αίτημα δύναται να συνάψει συναλλαγή με την αποδοχή του ζεύγους ή των ζευγών εντολών που θα του παρασχεθούν κατόπιν του αιτήματος.

3) Ως «σύστημα προφορικής διαπραγμάτευσης» νοείται ένα σύστημα διαπραγμάτευσης στο οποίο οι συναλλαγές μεταξύ των μελών κανονίζονται μέσω προφορικής διαπραγμάτευσης.

▼B

ΚΕΦΑΛΑΙΟ II

ΠΡΟΣΥΝΑΛΛΑΚΤΙΚΗ ΔΙΑΦΑΝΕΙΑ ΓΙΑ ΡΥΘΜΙΖΟΜΕΝΕΣ ΑΓΟΡΕΣ, ΠΟΛΥΜΕΡΕΙΣ ΜΗΧΑΝΙΣΜΟΙ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΗΣ ΚΑΙ ΟΡΓΑΝΩΜΕΝΟΙ ΜΗΧΑΝΙΣΜΟΙ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΗΣ

Άρθρο 2

Υποχρεώσεις προσυναλλακτικής διαφάνειας

[άρθρο 8 παράγραφοι 1 και 2 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014]

Οι φορείς της αγοράς και οι επιχειρήσεις επενδύσεων που διαχειρίζονται έναν τόπο διαπραγμάτευσης δημοσιοποιούν το εύρος των τιμών αγοράς και πώλησης, καθώς και το μέγεθος των εκδηλώσεων ενδιαφέροντος στις τιμές αυτές, σύμφωνα με τον τύπο του συστήματος διαπραγμάτευσης που διαχειρίζονται και τις απαιτήσεις πληροφόρησης που ορίζονται στο παράρτημα I

Άρθρο 3

Εντολές μεγάλης κλίμακας

[άρθρο 9 παράγραφος 1 στοιχείο α) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014]

Μια εντολή είναι μεγάλης κλίμακας σε σύγκριση με τον συνήθη όγκο των συναλλαγών στις περιπτώσεις όπου, κατά τον χρόνο εισαγωγής της εντολής ή μετά από οποιαδήποτε τροποποίηση της εντολής, είναι ίση ή μεγαλύτερη από το ελάχιστο μέγεθος της εντολής η οποία καθορίζεται σύμφωνα με τη μεθοδολογία που ορίζεται στο άρθρο 13.

Άρθρο 4

Είδος και ελάχιστο μέγεθος εντολών που τηρούνται σε μηχανισμό διαχείρισης εντολών

[άρθρο 9 παράγραφος 1 στοιχείο α) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014]

1. Το είδος της εντολής που τηρείται σε μηχανισμό διαχείρισης εντολών ενός τόπου διαπραγμάτευσης εν αναμονή της δημοσιοποίησής της στην αγορά, για την οποία μπορεί να χορηγηθεί απαλλαγή από τις υποχρεώσεις προσυναλλακτικής διαφάνειας, είναι μια εντολή η οποία:

α) προορίζεται να δημοσιοποιηθεί στο βιβλίο εντολών που διαχειρίζεται ο τόπος διαπραγμάτευσης και εξαρτάται από αντικειμενικούς όρους οι οποίοι έχουν καθορίζονται εκ των προτέρων από το πρωτόκολλο του συστήματος·

β) δεν αλληλεπιδρά με άλλα συναλλακτικά συμφέροντα πριν από τη δημοσιοποίησή της στο βιβλίο εντολών το οποίο διαχειρίζεται ο τόπος διαπραγμάτευσης·

γ) μόλις δημοσιοποιηθεί στο βιβλίο εντολών, αλληλεπιδρά με άλλες εντολές σύμφωνα με τους κανόνες που ισχύουν για εντολές τέτοιου είδους κατά τον χρόνο της δημοσιοποίησής της.

2. Το ελάχιστο μέγεθος των εντολών που τηρούνται σε μηχανισμό διαχείρισης εντολών ενός τόπου διαπραγμάτευσης εν αναμονή της δημοσιοποίησής τους στην αγορά, για τις οποίες μπορεί να χορηγηθεί απαλλαγή από τις υποχρεώσεις προσυναλλακτικής διαφάνειας, είναι, κατά τον χρόνο εισαγωγής τους και μετά από οποιαδήποτε τροποποίηση, κάποιο από τα κατωτέρω:

▼B

α) στην περίπτωση εντολής με αποθεματικό (reserve order), μεγαλύτερο από ή ίσο με 10 000 ευρώ·

β) για όλες τις άλλες εντολές, μεγαλύτερο από ή ίσο με την ελάχιστη διαπραγματεύσιμη ποσότητα που τίθεται εκ των προτέρων από τον διαχειριστή του συστήματος σύμφωνα με τους κανόνες και τα πρωτόκολλά του.

3. Εντολή με αποθεματικό, όπως αναφέρεται στην παράγραφο 2 στοιχείο α), θεωρείται μια εντολή με όριο τιμής η οποία αποτελείται από μια γνωστοποιημένη εντολή η οποία αφορά μέρος της ποσότητας και μια μη γνωστοποιημένη εντολή η οποία αφορά την υπόλοιπη ποσότητα, στην περίπτωση που η μη γνωστοποιημένη ποσότητα μπορεί να εκτελεστεί μόνο μετά τη δημοσίευσή της στο βιβλίο εντολών ως νέα γνωστοποιημένη εντολή.

Άρθρο 5

Συγκεκριμένο μέγεθος ανά χρηματοπιστωτικό μέσο

[άρθρο 8 παράγραφος 4 και άρθρο 9 παράγραφος 1 στοιχείο β) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014]

1. Μια επιδεκτική εκτέλεσης εκδήλωση ενδιαφέροντος βρίσκεται πάνω από το συγκεκριμένο μέγεθος ανά πιστωτικό μέσο στις περιπτώσεις όπου, κατά τον χρόνο εισαγωγής ή μετά από οποιαδήποτε τροποποίηση, είναι ίση ή μεγαλύτερη από το ελάχιστο μέγεθος μιας επιδεκτικής εκτέλεσης εκδήλωσης ενδιαφέροντος που καθορίζεται σύμφωνα με τη μεθοδολογία που ορίζεται στο άρθρο 13.

2. Ενδεικτικές προσυναλλακτικές τιμές για επιδεκτικές εκτέλεσης εκδήλωσης ενδιαφέροντος που βρίσκονται πάνω από το συγκεκριμένο μέγεθος ανά χρηματοπιστωτικό μέσο που καθορίζεται σύμφωνα με την παράγραφο 1 και κάτω από το σχετικό μέγεθος μεγάλης κλίμακας που καθορίζεται σύμφωνα με το άρθρο 3, πρέπει να θεωρούνται ότι προσεγγίζουν την τιμή του συναλλακτικού ενδιαφέροντος στις περιπτώσεις όπου ο τόπος διαπραγμάτευσης δημοσιοποιεί οποιοδήποτε από τα ακόλουθα:

α) τη βέλτιστη διαθέσιμη τιμή·

β) έναν απλό μέσο όρο τιμών·

γ) μια μέση σταθμισμένη τιμή βάσει του όγκου, της τιμής, του χρόνου ή του αριθμού των επιδεκτικών εκτέλεσης εκδηλώσεων ενδιαφέροντος.

3. Οι φορείς της αγοράς και οι επιχειρήσεις επενδύσεων που διαχειρίζονται έναν τόπο διαπραγμάτευσης δημοσιοποιούν τη μεθοδολογία για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών τιμών και τον χρόνο δημοσιοποίησης κατά την υποβολή και την επικαιροποίηση ενδεικτικών προσυναλλακτικών τιμών.

Άρθρο 6

Οι κατηγορίες χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία δεν υπάρχει ρευστή αγορά

[άρθρο 9 παράγραφος 1 στοιχείο γ) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014]

Ένα χρηματοπιστωτικό μέσο ή μία κατηγορία χρηματοπιστωτικών μέσων θεωρείται πως δεν έχει ρευστή αγορά εφόσον αυτό προσδιορίζεται σύμφωνα με τη μεθοδολογία που ορίζεται στο άρθρο 13.

▼B

ΚΕΦΑΛΑΙΟ III

ΜΕΤΑΣΥΝΑΛΛΑΚΤΙΚΗ ΔΙΑΦΑΝΕΙΑ ΓΙΑ ΤΟΥΣ ΤΟΠΟΥΣ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΗΣ ΚΑΙ ΤΙΣ ΕΠΙΧΕΙΡΗΣΕΙΣ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ ΠΟΥ ΠΡΑΓΜΑΤΟΠΟΙΟΥΝ ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ ΕΚΤΟΣ ΤΟΠΟΥ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΗΣ

Άρθρο 7

Υποχρεώσεις μετασυναλλακτικής διαφάνειας

[άρθρο 10 παράγραφος 1 και άρθρο 21 παράγραφοι 1 και 5 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014]

1. Οι επιχειρήσεις επενδύσεων που πραγματοποιούν συναλλαγές εκτός του τόπου διαπραγμάτευσης και οι φορείς της αγοράς και οι επιχειρήσεις επενδύσεων που διαχειρίζονται έναν τόπο διαπραγμάτευσης δημοσιοποιούν μέσω παραπομπής σε κάθε συναλλαγή τα λεπτομερή στοιχεία που ορίζονται στους πίνακες 1 και 2 του παραρτήματος ΙΙ και χρησιμοποιούν κάθε ισχύουσα επισήμανση που παρατίθεται στον πίνακα 3 του παραρτήματος ΙΙ.

2. Στην περίπτωση ακύρωσης μιας αναφοράς συναλλαγής που έχει προηγουμένως δημοσιοποιηθεί, οι επιχειρήσεις επενδύσεων που πραγματοποιούν συναλλαγές εκτός τόπου διαπραγμάτευσης, οι φορείς της αγοράς και οι επιχειρήσεις επενδύσεων που διαχειρίζονται τόπο διαπραγμάτευσης δημοσιοποιούν νέα αναφορά συναλλαγής, η οποία περιέχει όλα τα λεπτομερή στοιχεία της αρχικής αναφοράς συναλλαγής και τη σήμανση ακύρωσης που προσδιορίζεται στον πίνακα 3 του παραρτήματος ΙΙ.

3. Στην περίπτωση τροποποίησης μιας αναφοράς συναλλαγής που έχει προηγουμένως δημοσιοποιηθεί, οι επιχειρήσεις επενδύσεων που πραγματοποιούν συναλλαγές εκτός τόπου διαπραγμάτευσης και οι διαχειριστές αγοράς και επιχειρήσεις επενδύσεων που διαχειρίζονται έναν τόπο διαπραγμάτευσης δημοσιοποιούν τις κατωτέρω πληροφορίες:

α) νέα αναφορά συναλλαγής η οποία περιέχει όλα τα λεπτομερή στοιχεία της αρχικής αναφοράς συναλλαγής και τη σήμανση ακύρωσης που προσδιορίζεται στον πίνακα 3 του παραρτήματος ΙΙ·

β) νέα αναφορά συναλλαγής η οποία περιέχει όλα τα λεπτομερή στοιχεία της αρχικής αναφοράς συναλλαγής με διορθωμένα όλα τα απαραίτητα λεπτομερή στοιχεία και τη σήμανση τροποποίησης όπως προσδιορίζεται στον πίνακα 3 του παραρτήματος Ι.

4. Προσυναλλακτικές πληροφορίες διατίθενται όσο το δυνατόν πλησιέστερα στον πραγματικό χρόνο είναι τεχνικά εφικτό και σε κάθε περίπτωση:

α) για τα τρία πρώτα έτη εφαρμογής του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, εντός 15 λεπτών από την εκτέλεση της σχετικής συναλλαγής·

β) εν συνεχεία, εντός 5 λεπτών από την εκτέλεση της σχετικής συναλλαγής.

5. Στην περίπτωση που μια συναλλαγή μεταξύ δύο επιχειρήσεων επενδύσεων ολοκληρώνεται εκτός του πλαισίου των κανόνων τόπου διαπραγμάτευσης, είτε για ίδιο λογαριασμό είτε εκ μέρους πελατών, μόνο η επιχείρηση επενδύσεων η οποία πωλεί το οικείο χρηματοπιστωτικό μέσο δημοσιοποιεί τη συναλλαγή μέσω ενός ΕΜΔ.

6. Κατά παρέκκλιση της παραγράφου 5, όταν μόνο μία από τις επιχειρήσεις επενδύσεων που συμμετέχουν σε μια συναλλαγή είναι συστηματικός εσωτερικοποιητής για το δεδομένο χρηματοπιστωτικό μέσο και ενεργεί ως αγοράζουσα επιχείρηση, μόνο η εν λόγω επιχείρηση δημοσιοποιεί τη συναλλαγή μέσω ενός ΕΜΔ, ενημερώνοντας τον πωλητή για τις ενέργειες που πραγματοποίησε.

▼B

7. Οι επιχειρήσεις επενδύσεων λαμβάνουν κάθε εύλογο μέτρο προκειμένου να διασφαλίσουν ότι η συναλλαγή δημοσιοποιείται ως ενιαία συναλλαγή. Για το σκοπό αυτό, δυο αντιστοιχισμένες πράξεις που συνάπτονται κατά τον ίδιο χρόνο και για την ίδια τιμή με την παρεμβολή του ίδιου μέρους θεωρούνται ενιαία συναλλαγή.

8. Πληροφορίες σχετικά με μια συναλλαγή πακέτου καθίστανται διαθέσιμες σε σχέση με κάθε στοιχείο όσο το δυνατόν πλησιέστερα στον πραγματικό χρόνο είναι τεχνικά εφικτό, λαμβάνοντας υπόψη την ανάγκη κατανομής των τιμών σε συγκεκριμένα χρηματοπιστωτικά μέσα και περιλαμβάνουν την επισήμανση συναλλαγής πακέτου ή την επισήμανση συναλλαγής με ανταλλαγή με φυσικές παραδόσεις όπως ορίζεται στον πίνακα 3 του παραρτήματος ΙΙ. Σε περίπτωση που η συναλλαγή πακέτου είναι επιλέξιμη για αναβολή δημοσιοποίησης σύμφωνα με το άρθρο 8, οι πληροφορίες για όλα τα στοιχεία διατίθενται αφού παρέλθει η περίοδος αναβολής για τη συναλλαγή.

Άρθρο 8

Αναβολή δημοσίευσης συναλλαγών

[άρθρο 11 παράγραφοι 1 και 3 και άρθρο 21 παράγραφος 4 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014]

1. Στην περίπτωση που μια αρμόδια αρχή εγκρίνει την αναβολή της δημοσίευσης των λεπτομερών στοιχείων συναλλαγών σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 1 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, οι επιχειρήσεις επενδύσεων που πραγματοποιούν συναλλαγές εκτός τόπου διαπραγμάτευσης και οι φορείς της αγοράς που διαχειρίζονται έναν τόπο διαπραγμάτευσης δημοσιοποιούν κάθε συναλλαγή το αργότερο έως τις 19:00 τοπική ώρα τη δεύτερη εργάσιμη ημέρα μετά την ημερομηνία της συναλλαγής, εφόσον πληρούται μία από τις ακόλουθες προϋποθέσεις:

α) η συναλλαγή είναι μεγάλης κλίμακας σε σχέση με τον συνήθη όγκο των συναλλαγών όπως ορίζεται στο άρθρο 9·

β) η συναλλαγή είναι ένα χρηματοπιστωτικό μέσο ή μία κατηγορία χρηματοπιστωτικών μέσων για την οποία δεν υπάρχει ρευστή αγορά όπως αυτό προσδιορίζεται σύμφωνα με τη μεθοδολογία που ορίζεται στο άρθρο 13.

γ) η συναλλαγή εκτελείται μεταξύ μιας επιχείρησης επενδύσεων που διενεργεί συναλλαγές για ίδιο λογαριασμό εκτός της αντιστοιχισμένης συναλλαγής για ίδιο λογαριασμό σύμφωνα με το άρθρο 4 παράγραφος 1 στοιχείο 38 της οδηγίας 2014/65/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ([1]) και ενός άλλου αντισυμβαλλομένου και υπερβαίνει το συγκεκριμένο μέγεθος ανά πιστωτικό μέσο όπως καθορίζεται στο άρθρο 10·

δ) η συναλλαγή είναι μια συναλλαγή πακέτου που πληροί ένα από τα ακόλουθα κριτήρια:

i) ένα ή περισσότερα από τα στοιχεία της είναι συναλλαγές σε χρηματοπιστωτικά μέσα τα οποία δεν έχουν ρευστή αγορά·

ii) ένα ή περισσότερα από τα στοιχεία της είναι συναλλαγές σε χρηματοπιστωτικά μέσα που είναι μεγάλης κλίμακας σε σχέση με τον συνήθη όγκο των συναλλαγών, όπως ορίζεται στο άρθρο 9·

([1]) Οδηγία 2014/65/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου της 15ης Μαΐου 2014 για τις αγορές χρηματοπιστωτικών μέσων και την τροποποίηση της οδηγίας 2002/92/ΕΚ και της οδηγίας 2011/61/ΕΕ (ΕΕ L 173 της 12.6.2014, σ. 349).

▼B

iii) η συναλλαγή εκτελείται μεταξύ μιας επιχείρησης επενδύσεων που διενεργεί συναλλαγές για ίδιο λογαριασμό εκτός της αντιστοιχισμένης συναλλαγής για ίδιο λογαριασμό σύμφωνα με το άρθρο 4 παράγραφος 1 σημείο 38) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ και ένα ή περισσότερα από τα στοιχεία της είναι συναλλαγές σε χρηματοπιστωτικά μέσα που υπερβαίνουν το συγκεκριμένο μέγεθος ανά πιστωτικό μέσο όπως καθορίζεται στο άρθρο 10·

2. Όταν παρέλθει η προθεσμία αναβολής που ορίζεται στην παράγραφο 1, όλα τα λεπτομερή στοιχεία της συναλλαγής δημοσιοποιούνται, εκτός εάν επεκταθεί η χρονική περίοδος αναβολής ή χορηγηθεί αναβολή επ' αόριστον σύμφωνα με το άρθρο 11.

3. ►C1 Στην περίπτωση που μια συναλλαγή μεταξύ δύο επιχειρήσεων επενδύσεων, είτε για ίδιο λογαριασμό είτε εκ μέρους πελατών, εκτελείται εκτός του πλαισίου κανόνων ενός τόπου διαπραγμάτευσης, η σχετική αρμόδια αρχή για σκοπούς καθορισμού του εφαρμοζόμενου καθεστώτος αναβολής θεωρείται η αρμόδια αρχή της επιχείρησης επενδύσεων που είναι υπεύθυνη για τη δημοσιοποίηση μέσω ενός ΕΜΔ, σύμφωνα με τις παραγράφους 5, 6 και 7 του άρθρου 7. ◄

Άρθρο 9

Συναλλαγές μεγάλης κλίμακας

[άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχείο α) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014]

Μια συναλλαγή θεωρείται μεγάλης κλίμακας σε σχέση με τον συνήθη όγκο των συναλλαγών όταν είναι ίσου ή μεγαλύτερου μεγέθους από το ελάχιστο μέγεθος της συναλλαγής, η οποία υπολογίζεται σύμφωνα με τη μεθοδολογία που ορίζεται στο άρθρο 13.

Άρθρο 10

Συγκεκριμένο μέγεθος ανά χρηματοπιστωτικό μέσο

[άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχείο γ) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014]

Μια συναλλαγή θεωρείται πως είναι πάνω από το συγκεκριμένο μέγεθος ανά χρηματοπιστωτικό μέσο όταν είναι ίσου ή μεγαλύτερου μεγέθους από το ελάχιστο μέγεθος της συναλλαγής, η οποία υπολογίζεται σύμφωνα με τη μεθοδολογία που ορίζεται στο άρθρο 13.

Άρθρο 11

Απαιτήσεις διαφάνειας σε συνδυασμό με την αναβολή δημοσίευσης κατά τη διακριτική ευχέρεια των αρμόδιων αρχών

[άρθρο 11 παράγραφος 3 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014]

1. Όταν οι αρμόδιες αρχές ασκούν τις αρμοδιότητές τους σύμφωνα με την άδεια αναστολής δημοσίευσης δυνάμει του άρθρου 11 παράγραφος 3 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, ισχύουν τα ακόλουθα:

α) όταν ισχύει το άρθρο 11 παράγραφος 3 στοιχείο α) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, οι αρμόδιες αρχές ζητούν τη δημοσιοποίηση οποιασδήποτε εκ των ακόλουθων πληροφοριών κατά τη διάρκεια της πλήρους περιόδου αναβολής, όπως ορίζεται στο άρθρο 8:

i) όλα τα λεπτομερή στοιχεία μιας συναλλαγής που καθορίζονται στους πίνακες 1 και 2 του παραρτήματος ΙΙ με εξαίρεση τα λεπτομερή στοιχεία σχετικά με τον όγκο·

▼B

ii) συναλλαγές σε ημερήσια ομαδοποιημένη μορφή για έναν ελάχιστο αριθμό 5 εκτελεσθεισών συναλλαγών την ίδια μέρα, οι οποίες πρέπει να δημοσιοποιούνται την επομένη εργάσιμη ημέρα πριν από τις 09:00 τοπική ώρα·

β) όταν ισχύει το άρθρο 11 παράγραφος 3 στοιχείο β) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, οι αρμόδιες αρχές επιτρέπουν την παράλειψη της δημοσιοποίησης του όγκου μιας μεμονωμένης συναλλαγής για παρατεταμένο χρονικό διάστημα τεσσάρων εβδομάδων·

γ) όσον αφορά τα μη μετοχικά χρηματοπιστωτικά μέσα τα οποία δεν αποτελούν κρατικούς χρεωστικούς τίτλους και στις περιπτώσεις που ισχύει το άρθρο 11 παράγραφος 3 στοιχείο γ) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, οι αρμόδιες αρχές επιτρέπουν, για παρατεταμένη χρονική περίοδο αναβολής τεσσάρων εβδομάδων, τη δημοσιοποίηση της ομαδοποίησης πολλών συναλλαγών που εκτελούνται κατά τη διάρκεια μιας ημερολογιακής εβδομάδας την επόμενη Τρίτη πριν από τις 09:00 τοπική ώρα·

δ) όσον αφορά τους κρατικούς χρεωστικούς τίτλους και στις περιπτώσεις που ισχύει το άρθρο 11 παράγραφος 3 στοιχείο δ) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, οι αρμόδιες αρχές επιτρέπουν, για αόριστο χρονικό διάστημα, τη δημοσιοποίηση της ομαδοποίησης πολλών συναλλαγών που εκτελούνται κατά τη διάρκεια μιας ημερολογιακής εβδομάδας την επόμενη Τρίτη πριν από τις 09:00 τοπική ώρα.

2. Όταν παρέλθει η παρατεταμένη περίοδος αναβολής που ορίζεται στην παράγραφο 1 στοιχείο β), ισχύουν οι ακόλουθες απαιτήσεις:

α) όσον αφορά το σύνολο των μέσων που δεν αποτελούν κρατικούς χρεωστικούς τίτλους, δημοσιοποίηση των πλήρων λεπτομερών στοιχείων όλων των επιμέρους συναλλαγών, την επόμενη εργάσιμη ημέρα πριν από τις 9:00 τοπική ώρα·

β) όσον αφορά τους κρατικούς χρεωστικούς τίτλους όταν οι αρμόδιες αρχές αποφασίζουν να μην χρησιμοποιήσουν τις επιλογές που προβλέπονται στο άρθρο 11 παράγραφος 3 στοιχεία β) και δ) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 διαδοχικά, σύμφωνα με το δεύτερο εδάφιο του άρθρου 11 παράγραφος 3 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, δημοσιοποίηση των πλήρων λεπτομερών στοιχείων όλων των επιμέρους συναλλαγών την επόμενη εργάσιμη ημέρα πριν τις 9:00 τοπική ώρα·

γ) όσον αφορά κρατικούς χρεωστικού τίτλους, όταν οι αρμόδιες αρχές εφαρμόζουν τις επιλογές που προβλέπονται στο άρθρο 11 παράγραφος 3 στοιχεία β) και δ) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 διαδοχικά σύμφωνα με το δεύτερο εδάφιο του άρθρου 11 παράγραφος 3 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, δημοσιοποίηση πολλών συναλλαγών που εκτελούνται την ίδια ημερολογιακή εβδομάδα σε ομαδοποιημένη μορφή, την Τρίτη μετά τη λήξη της παρατεταμένης περιόδου αναβολής τεσσάρων εβδομάδων από την τελευταία ημέρα της εν λόγω ημερολογιακής εβδομάδας πριν τις 9:00 τοπική ώρα.

3. Σε σχέση με το σύνολο των μέσων που δεν αποτελούν κρατικούς χρεωστικούς τίτλους, όλα τα λεπτομερή στοιχεία των συναλλαγών σε ατομική βάση δημοσιεύονται τέσσερις εβδομάδας μετά τη δημοσίευση των ομαδοποιημένων λεπτομερών στοιχείων σύμφωνα με την παράγραφο 1 στοιχείο γ) πριν τις 9:00 τοπική ώρα.

4. Τα ομαδοποιημένα ημερήσια ή εβδομαδιαία δεδομένα που αναφέρονται στις παραγράφους 1 και 2 περιλαμβάνουν τις ακόλουθες πληροφορίες για ομολογίες, δομημένα χρηματοπιστωτικά προϊόντα, δικαιώματα εκπομπής και παράγωγα όσον αφορά κάθε ημέρα ή εβδομάδα της οικείας ημερολογιακής περιόδου:

α) τη σταθμισμένη μέση τιμή·

▼B

β) τον συνολικό όγκο διαπραγμάτευσης όπως αναφέρεται στον πίνακα 4 του παραρτήματος ΙΙ·

γ) τον συνολικό αριθμό συναλλαγών.

5. Οι συναλλαγές ομαδοποιούνται ανά κωδικό ISIN. Σε περίπτωση που ο κωδικός ISIN δεν είναι διαθέσιμος, οι συναλλαγές ομαδοποιούνται στο επίπεδο της κατηγορίας χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία ισχύει η δοκιμασία ρευστότητας που ορίζεται στο άρθρο 13.

6. Όταν η ημέρα της εβδομάδας που προβλέπεται για τις δημοσιοποιήσεις και που ορίζεται στην παράγραφο 1 σημεία γ) και δ) και στις παραγράφους 2 και 3 δεν είναι εργάσιμη ημέρα, οι δημοσιοποιήσεις πραγματοποιούνται την επομένη εργάσιμη ημέρα πριν τις 9:00 τοπική ώρα.

Άρθρο 12

Εφαρμογή μετασυναλλακτικής διαφάνειας σε ορισμένες συναλλαγές που εκτελούνται εκτός τόπου διαπραγμάτευσης

[άρθρο 21 παράγραφος 1 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014)]

Η υποχρέωση δημοσιοποίησης του όγκου και της τιμής των συναλλαγών και ο χρόνος κατά τον οποίο ολοκληρώνονται όπως ορίζεται στο άρθρο 21 παράγραφος 1 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 δεν ισχύουν για οποιαδήποτε από τα ακόλουθα:

α) συναλλαγές που απαριθμούνται στο άρθρο 2 παράγραφος 5 του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/590 της Επιτροπής ([1])·

β) συναλλαγές οι οποίες εκτελούνται από εταιρεία διαχείρισης, όπως ορίζεται στο άρθρο 2 παράγραφος 1 στοιχείο β) της οδηγίας 2009/65/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ([2]), ή από διαχειριστή οργανισμού εναλλακτικών επενδύσεων, όπως ορίζεται στο άρθρο 4 παράγραφος 1 στοιχείο β) της οδηγίας 2011/61/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ([3]), που μεταβιβάζουν την πραγματική κυριότητα χρηματοπιστωτικών μέσων από έναν οργανισμό συλλογικών επενδύσεων σε άλλον και καμία επιχείρηση επενδύσεων δεν είναι συμβαλλόμενο μέρος στη συναλλαγή·

γ) «συναλλαγή παράδοσης (give-up)» ή «συναλλαγή αποδοχής (give-in)», η οποία είναι μια συναλλαγή κατά την οποία μια επιχείρηση επενδύσεων διαβιβάζει συναλλαγή πελάτη σε, ή λαμβάνει συναλλαγή πελάτη από, άλλη επιχείρηση επενδύσεων για σκοπούς μετασυναλλακτικής επεξεργασίας·

δ) μεταβιβάσεις χρηματοπιστωτικών μέσων όπως εξασφάλιση σε διμερείς συναλλαγές ή στο πλαίσιο υποχρεώσεων καθορισμού περιθωρίου ή παροχής ασφάλειας από κεντρικό αντισυμβαλλόμενο ή ως μέρος της διαδικασίας διαχείρισης αθέτησης υποχρέωσης από κεντρικό αντισυμβαλλόμενο.

([1]) Κατ' εξουσιοδότηση κανονισμός (ΕΕ) 2017/590 της Επιτροπής, της 28ης Ιουλίου 2016, για την εφαρμογή του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου όσον αφορά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα για την αναφορά των συναλλαγών στις αρμόδιες αρχές (βλέπε σελίδα 449 της παρούσας Επίσημης Εφημερίδας).

([2]) Οδηγία 2009/65/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου της 13ης Ιουλίου 2009 για τον συντονισμό των νομοθετικών, κανονιστικών και διοικητικών διατάξεων σχετικά με ορισμένους οργανισμούς συλλογικών επενδύσεων σε κινητές αξίες (ΟΣΕΚΑ) (ΕΕ L 302 της 17.11.2009, σ. 32).

([3]) Οδηγία 2011/61/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου της 8ης Ιουνίου 2011 σχετικά με τους διαχειριστές οργανισμών εναλλακτικών επενδύσεων και για την τροποποίηση των οδηγιών 2003/41/ΕΚ και 2009/65/ΕΚ και των κανονισμών (ΕΚ) αριθ. 1060/2009 και (ΕΕ) αριθ. 1095/2010 (ΕΕ L 174 της 1.7.2011, σ. 1).

▼B

ΚΕΦΑΛΑΙΟ IV

ΚΟΙΝΕΣ ΔΙΑΤΑΞΕΙΣ ΓΙΑ ΤΗΝ ΠΡΟΣΥΝΑΛΛΑΚΤΙΚΗ ΚΑΙ ΜΕΤΑΣΥΝΑΛΛΑΚΤΙΚΗ ΔΙΑΦΑΝΕΙΑ

Άρθρο 13

Μεθοδολογία για την εκτέλεση των υπολογισμών διαφάνειας

[άρθρο 9 παράγραφοι 1 και 2, άρθρο 11 παράγραφος 1 και άρθρο 22 παράγραφος 1 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014]

1. Για τον προσδιορισμό των χρηματοπιστωτικών μέσων ή κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία δεν υπάρχει ρευστή αγορά για τους σκοπούς του άρθρου 6 και του άρθρου 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εφαρμόζονται οι ακόλουθες μεθοδολογίες σε όλες τις κατηγορίες περιουσιακών στοιχείων:

α) στατικός προσδιορισμός της ρευστότητας για:

i) την κατηγορία περιουσιακών στοιχείων των τιτλοποιημένων παραγώγων, όπως ορίζεται στον πίνακα 4.1 του παραρτήματος ΙΙΙ·

ii) τις ακόλουθες υποκατηγορίες περιουσιακών στοιχείων παραγώγων επί μετοχών: δικαιώματα αγοράς με βάση δείκτη μετοχών, συμβόλαια μελλοντικής/προθεσμιακής εκπλήρωσης με βάση δείκτη μετοχών, δικαιώματα αγοράς ιδίων μετοχών, συμβόλαια μελλοντικής/προθεσμιακής εκπλήρωσης, δικαιώματα αγοράς μερισμάτων υπό μορφή νέων μετοχών, συμβόλαια μελλοντικής/προθεσμιακής εκπλήρωσης δικαιωμάτων μερισμάτων, δικαιώματα αγοράς μερισμάτων με βάση δείκτη μετοχών, συμβόλαια μελλοντικής/προθεσμιακής εκπλήρωσης μερισμάτων με βάση δείκτη μετοχών, δικαιώματα μερισμάτων δείκτη μεταβλητότητας, συμβόλαια μελλοντικής/προθεσμιακής εκπλήρωσης με βάση δείκτη μεταβλητότητας, δικαιώματα αγοράς ΔΑΚ, συμβόλαια μελλοντικής/προθεσμιακής εκπλήρωσης ΔΑΚ και άλλα παράγωγα επί μετοχών όπως ορίζονται στον πίνακα 6.1 του παραρτήματος ΙΙΙ·

iii) την κατηγορία παραγώγων επί συναλλάγματος, όπως ορίζεται στον πίνακα 8.1 του παραρτήματος ΙΙΙ·

iv) υποκατηγορίες περιουσιακών στοιχείων άλλων παραγώγων επί επιτοκίων, άλλων παραγώγων επί εμπορευμάτων, άλλων πιστωτικών παραγώγων, άλλων παραγώγων C10, άλλων συμβάσεων επί διαφορών (CFDs), άλλων δικαιωμάτων εκπομπής και άλλων παραγώγων επί δικαιωμάτων εκπομπής όπως ορίζεται στους πίνακες 5.1, 7.1, 9.1, 10.1, 11.1, 12.1 και 13.1 του παραρτήματος ΙΙΙ·

β) περιοδική αξιολόγηση βάσει ποσοτικών και, κατά περίπτωση, ποιοτικών κριτηρίων ρευστότητας για:

i) όλους τους τύπους ομολογιών πλην των ETC και των ETN όπως ορίζεται στον Πίνακα 2.1 του παραρτήματος ΙΙΙ και όπως ορίζεται στο άρθρο 17 παράγραφος 1·

ii) τύπους όπως ETC και ETN όπως ορίζεται στον Πίνακα 2.4 του παραρτήματος ΙΙΙ·

iii) κατηγορία περιουσιακών στοιχείων παραγώγων επί επιτοκίων πλην της υποκατηγορία περιουσιακών στοιχείων άλλων παραγώγων επί επιτοκίων όπως ορίζεται στον Πίνακα 5.1 του παραρτήματος ΙΙΙ·

▼B

iv) τις ακόλουθες υποκατηγορίες περιουσιακών στοιχείων παραγώγων επί μετοχών: συμφωνίες ανταλλαγής και συμφωνίες ανταλλαγής χαρτοφυλακίου όπως ορίζεται στον Πίνακα 6.1 του παραρτήματος ΙΙΙ·

v) κατηγορία περιουσιακών στοιχείων παραγώγων επί εμπορευμάτων πλην της υποκατηγορίας περιουσιακών στοιχείων άλλων παραγώγων επί εμπορευμάτων όπως ορίζεται στον Πίνακα 7.1 του παραρτήματος ΙΙΙ·

vi) τις ακόλουθες υποκατηγορίες περιουσιακών στοιχείων πιστωτικών παραγώγων: συμφωνίες ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης δείκτη και συμφωνίες ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης μεμονωμένου οφειλέτη όπως ορίζεται στον Πίνακα 9.1 του παραρτήματος ΙΙΙ·

vii) κατηγορία περιουσιακών στοιχείων παραγώγων C10 πλην της υποκατηγορίας περιουσιακών στοιχείων άλλων παραγώγων C10 όπως ορίζεται στον Πίνακα 10.1 του παραρτήματος ΙΙΙ·

viii) τις ακόλουθες υποκατηγορίες περιουσιακών στοιχείων συμβάσεων επί διαφοράς (CFDs): CFDs νομισμάτων και CFDs εμπορευμάτων όπως ορίζεται στον Πίνακα 11.1 του παραρτήματος ΙΙΙ·

ix) κατηγορία περιουσιακών στοιχείων δικαιωμάτων εκπομπής πλην της υποκατηγορίας περιουσιακών στοιχείων άλλων δικαιωμάτων εκπομπής όπως ορίζεται στον Πίνακα 12.1 του παραρτήματος ΙΙΙ·

x) κατηγορία περιουσιακών στοιχείων παραγώγων επί δικαιωμάτων εκπομπής πλην της υποκατηγορίας περιουσιακών στοιχείων άλλων παραγώγων επί δικαιωμάτων εκπομπής όπως ορίζεται στον Πίνακα 13.1 του παραρτήματος ΙΙΙ·

γ) περιοδική αξιολόγηση βάσει ποιοτικών κριτηρίων ρευστότητας για:

i) τις ακόλουθες υποκατηγορίες περιουσιακών στοιχείων πιστωτικών παραγώγων: δικαιώματα προαίρεσης CDS επί δεικτών και δικαιώματα προαίρεσης CDS μεμονωμένου οφειλέτη όπως ορίζεται στον Πίνακα 9.1 του παραρτήματος ΙΙΙ·

ii) τις ακόλουθες υποκατηγορίες περιουσιακών στοιχείων συμβάσεων επί διαφοράς (CFDs): CFD μετοχών, CFD ομολογιών, CFD σε συμβόλαια μελλοντικής/προθεσμιακής εκπλήρωσης επί μετοχών και CFD σε δικαιώματα προαίρεσης επί μετοχών, όπως ορίζεται στον Πίνακα 11.1 του παραρτήματος ΙΙΙ·

δ) περιοδική αξιολόγηση βάσει δύο μεθοδολογιών δοκιμασιών για δομημένα χρηματοπιστωτικά προϊόντα, όπως ορίζεται στον Πίνακα 3.1 του παραρτήματος ΙΙΙ.

2. Για τον προσδιορισμό του συγκεκριμένου μεγέθους ανά χρηματοπιστωτικό μέσο που αναφέρεται στο άρθρο 5 και των εντολών μεγάλης κλίμακας σε σύγκριση με τον συνήθη όγκο των συναλλαγών που αναφέρονται στο άρθρο 3, ισχύουν οι ακόλουθες μεθοδολογίες:

α) τιμή ορίου για:

i) τύπους ομολογιών ETC και ETN όπως ορίζεται στον Πίνακα 2.5 του παραρτήματος ΙΙΙ·

ii) την κατηγορία περιουσιακών στοιχείων των τιτλοποιημένων παραγώγων, όπως ορίζεται στον πίνακα 4.2 του παραρτήματος ΙΙΙ·

iii) κάθε υποκατηγορία παραγώγων επί μετοχών, όπως ορίζεται στους Πίνακες 6.2 και 6.3 του παραρτήματος ΙΙΙ·

▼B

iv) κάθε υποκατηγορία παραγώγων επί συναλλάγματος, όπως ορίζεται στον πίνακα 8.2 του παραρτήματος ΙΙΙ·

v) κάθε υποκατηγορία που θεωρείται ότι δεν έχει ρευστή αγορά για τις κατηγορίες περιουσιακών στοιχείων παραγώγων επί επιτοκίων, παραγώγων επί εμπορευμάτων, πιστωτικών παραγώγων, παραγώγων C10 και συμβάσεων επί διαφοράς (CFDs) όπως ορίζεται στους Πίνακες 5.3, 7.3, 9.3, 10.3 και 11.3 του παραρτήματος ΙΙΙ·

vi) κάθε υποκατηγορία περιουσιακών στοιχείων που θεωρείται ότι δεν έχει ρευστή αγορά για τις κατηγορίες περιουσιακών στοιχείων δικαιωμάτων εκπομπής και παραγώγων επί δικαιωμάτων εκπομπής, όπως ορίζεται στους Πίνακες 12.3 και 13.3 του παραρτήματος ΙΙΙ·

vii) κάθε δομημένο χρηματοπιστωτικό προϊόν το οποίο δεν έχει περάσει επιτυχώς τη Δοκιμασία-1 σύμφωνα με την παράγραφο 1 στοιχείο δ), όπως ορίζεται στον Πίνακα 3.2 του παραρτήματος ΙΙΙ·

viii) κάθε δομημένο χρηματοπιστωτικό προϊόν το οποίο θεωρείται ότι δεν έχει ρευστή αγορά, το οποίο έχει περάσει επιτυχώς μόνο τη Δοκιμασία-1 σύμφωνα με την παράγραφο 1 στοιχείο δ), όπως ορίζεται στον Πίνακα 3.3 του παραρτήματος ΙΙΙ·

β) Το μεγαλύτερο από το μέγεθος συναλλαγών κάτω από το οποίο βρίσκεται το ποσοστό των συναλλαγών που αντιστοιχεί το εκατοστημόριο συναλλαγής όπως ορίζεται περαιτέρω στο άρθρο 17 παράγραφος 3 και το κατώτατο όριο για:

i) κάθε τύπο ομολογιών, πλην των ETC και ETN, όπως ορίζεται στον Πίνακα 2.3 του παραρτήματος ΙΙΙ·

ii) κάθε υποκατηγορία που έχει ρευστή αγορά για τις κατηγορίες περιουσιακών στοιχείων παραγώγων επί επιτοκίων, παραγώγων επί εμπορευμάτων, πιστωτικών παραγώγων, παραγώγων C10 και CFDs, όπως ορίζεται στους Πίνακες 5.2, 7.2, 9.2, 10.2 και 11.2 του παραρτήματος ΙΙΙ·

iii) κάθε υποκατηγορία περιουσιακών στοιχείων που έχει ρευστή αγορά για τις κατηγορίες περιουσιακών στοιχείων δικαιωμάτων εκπομπής και παραγώγων επί δικαιωμάτων εκπομπής, όπως ορίζεται στους Πίνακες 12.2 και 13.2 του παραρτήματος ΙΙΙ·

iv) κάθε δομημένο χρηματοπιστωτικό προϊόν το οποίο θεωρείται ότι έχει ρευστή αγορά, το οποίο έχει περάσει επιτυχώς τη Δοκιμασία-1 και τη Δοκιμασία-2 σύμφωνα με την παράγραφο 1 στοιχείο δ), όπως ορίζεται στον Πίνακα 3.3 του παραρτήματος ΙΙΙ.

3. Για τον προσδιορισμό του συγκεκριμένου μεγέθους ανά χρηματοπιστωτικό μέσο που αναφέρεται στο άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο γ) και των συναλλαγών μεγάλης κλίμακας σε σύγκριση με τον συνήθη όγκο των συναλλαγών που αναφέρονται στο άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο α), ισχύουν οι ακόλουθες μεθοδολογίες:

α) τιμή ορίου για:

i) τύπους ομολογιών ETC και ETN όπως ορίζεται στον Πίνακα 2.5 του παραρτήματος ΙΙΙ·

ii) την κατηγορία περιουσιακών στοιχείων των τιτλοποιημένων παραγώγων, όπως ορίζεται στον πίνακα 4.2 του παραρτήματος ΙΙΙ·

iii) κάθε υποκατηγορία παραγώγων επί μετοχών, όπως ορίζεται στους Πίνακες 6.2 και 6.3 του παραρτήματος ΙΙΙ·

▼B

iv) κάθε υποκατηγορία παραγώγων επί συναλλάγματος, όπως ορίζεται στον πίνακα 8.2 του παραρτήματος ΙΙΙ·

v) κάθε υποκατηγορία που θεωρείται ότι δεν έχει ρευστή αγορά για τις κατηγορίες περιουσιακών στοιχείων παραγώγων επί επιτοκίων, παραγώγων επί εμπορευμάτων, πιστωτικών παραγώγων, παραγώγων C10 και συμβάσεων επί διαφοράς (CFDs) όπως ορίζεται στους Πίνακες 5.3, 7.3, 9.3, 10.3, και 11.3 του παραρτήματος ΙΙΙ·

vi) κάθε υποκατηγορία περιουσιακών στοιχείων που θεωρείται ότι δεν έχει ρευστή αγορά για την κατηγορία περιουσιακών στοιχείων δικαιωμάτων εκπομπής και παραγώγων επί δικαιωμάτων εκπομπής, όπως ορίζεται στους Πίνακες 12.3 και 13.3 του παραρτήματος ΙΙΙ·

vii) κάθε δομημένο χρηματοπιστωτικό προϊόν το οποίο δεν έχει περάσει επιτυχώς τη Δοκιμασία-1 σύμφωνα με την παράγραφο 1 στοιχείο δ), όπως ορίζεται στον Πίνακα 3.2 του παραρτήματος ΙΙΙ·

viii) κάθε δομημένο χρηματοπιστωτικό προϊόν το οποίο θεωρείται ότι δεν έχει ρευστή αγορά, το οποίο έχει περάσει επιτυχώς μόνο τη Δοκιμασία-1 σύμφωνα με την παράγραφο 1 στοιχείο δ), όπως ορίζεται στον Πίνακα 3.3 του παραρτήματος ΙΙΙ·

β) το μέγεθος συναλλαγών κάτω από το οποίο βρίσκεται το ποσοστό των συναλλαγών που αντιστοιχούν στο εκατοστημόριο συναλλαγής για κάθε τύπο ομολογιών, πλην των ETC και ETN, όπως ορίζεται στον Πίνακα 2.3 του παραρτήματος ΙΙΙ·

γ) το μεγαλύτερο από το μέγεθος συναλλαγών κάτω από το οποίο βρίσκεται το ποσοστό των συναλλαγών που αντιστοιχούν στο εκατοστημόριο συναλλαγής, το μέγεθος συναλλαγών κάτω από το οποίο βρίσκεται το ποσοστό του όγκου που αντιστοιχεί στο εκατοστημόριο όγκου και το κατώτατο όριο για κάθε υποκατηγορία που θεωρείται ότι έχει ρευστή αγορά για τις κατηγορίες περιουσιακών στοιχείων παραγώγων επί επιτοκίων, παραγώγων επί εμπορευμάτων, πιστωτικών παραγώγων, παραγώγων C10 και CDFs, όπως ορίζεται στους Πίνακες 5.2, 7.2, 9.2, 10.2 και 11.2 του παραρτήματος ΙΙΙ·

δ) το μεγαλύτερο από το μέγεθος συναλλαγών κάτω από το οποίο βρίσκεται το ποσοστό των συναλλαγών που αντιστοιχεί το εκατοστημόριο συναλλαγής και το κατώτατο όριο για:

i) κάθε υποκατηγορία περιουσιακών στοιχείων που θεωρείται ότι έχει ρευστή αγορά για τις κατηγορίες περιουσιακών στοιχείων δικαιωμάτων εκπομπής και παραγώγων επί δικαιωμάτων εκπομπής, όπως ορίζεται στους Πίνακες 12.2 και 13.2 του παραρτήματος ΙΙΙ·

ii) κάθε δομημένο χρηματοπιστωτικό προϊόν το οποίο θεωρείται ότι έχει ρευστή αγορά, το οποίο έχει περάσει επιτυχώς τη Δοκιμασία-1 και τη Δοκιμασία-2 σύμφωνα με την παράγραφο 1 στοιχείο δ), όπως ορίζεται στον Πίνακα 3.3 του παραρτήματος ΙΙΙ.

4. Για τους σκοπούς της παραγράφου 3 στοιχείο γ), στις περιπτώσεις που το μέγεθος συναλλαγών που αντιστοιχεί στο εκατοστημόριο όγκου για τον προσδιορισμό της συναλλαγής μεγάλης κλίμακας σε σύγκριση με τον συνήθη όγκο των συναλλαγών είναι μεγαλύτερο από το εκατοστημόριο συναλλαγών 97,5, το μέγεθος συναλλαγών δεν λαμβάνεται υπόψη και το συγκεκριμένο μέγεθος ανά χρηματοπιστωτικό μέσο που αναφέρεται στο άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο γ) και το μέγεθος των συναλλαγών μεγάλης κλίμακας σε σύγκριση με τον συνήθη όγκο των συναλλαγών που αναφέρεται στο άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο α), προσδιορίζονται ως το υψηλότερο από το μέγεθος συναλλαγών κάτω από το οποίο βρίσκεται το ποσοστό των συναλλαγών που αντιστοιχούν στο εκατοστημόριο συναλλαγών και το κατώτατο όριο.

▼B

5. Σύμφωνα με τους κατ' εξουσιοδότηση κανονισμούς (ΕΕ) 2017/590 και (ΕΕ) 2017/577, οι αρμόδιες αρχές συγκεντρώνουν σε καθημερινή βάση τα στοιχεία από τους τόπους διαπραγμάτευσης, τους ΕΜΔ και τους ΠΕΔ, τα οποία είναι αναγκαία για την εκτέλεση των υπολογισμών προκειμένου να καθορίζονται:

α) τα χρηματοπιστωτικά μέσα και οι κατηγορίες χρηματοπιστωτικών μέσω που δεν έχουν ρευστή αγορά όπως ορίζεται στην παράγραφο 1·

β) τα μεγέθη μεγάλης κλίμακας σε σύγκριση με τον συνήθη όγκο των συναλλαγών και το συγκεκριμένο μέγεθος ανά χρηματοπιστωτικό μέσο, όπως ορίζεται στις παραγράφους 2 και 3.

6. Οι αρμόδιες αρχές που εκτελούν τους υπολογισμούς για μια κατηγορία χρηματοπιστωτικών μέσων προβαίνουν σε ρυθμίσεις συνεργασίας μεταξύ τους ώστε να εξασφαλίζεται η συγκέντρωση των δεδομένων σε ολόκληρη την Ένωση, τα οποία είναι απαραίτητα για τους υπολογισμούς.

7. Για τους σκοπούς της παραγράφου 1 στοιχεία β) και δ), της παραγράφου 2 στοιχείο β) και της παραγράφου 3 στοιχεία β), γ) και δ), οι αρμόδιες αρχές λαμβάνουν υπόψη συναλλαγές που εκτελούνται εντός της Ένωσης από την 1η Ιανουαρίου έως την 31η Δεκεμβρίου του προηγούμενου έτους.

8. Το μέγεθος συναλλαγών για τους σκοπούς της παραγράφου 2 στοιχείο β) και της παραγράφου 3 στοιχεία γ) και δ) καθορίζεται σύμφωνα με τη μονάδα μέτρησης του όγκου όπως ορίζεται στον πίνακα 4 του παραρτήματος ΙΙ. Όπου το μέγεθος συναλλαγών που ορίζεται για τους σκοπούς των παραγράφων 2 και 3 εκφράζεται σε νομισματική αξία και το χρηματοπιστωτικό μέσο δεν εκφράζεται σε ευρώ, το μέγεθος συναλλαγών μετατρέπεται στο νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το χρηματοπιστωτικό μέσο εφαρμόζοντας τη συναλλαγματική ισοτιμία αναφοράς της Ευρωπαϊκής Κεντρικής Τράπεζας από τις 31 Δεκεμβρίου του προηγούμενου έτους.

9. Οι φορείς της αγοράς και οι επιχειρήσεις επενδύσεων που διαχειρίζονται έναν τόπο διαπραγμάτευσης μπορεί να μετατρέψουν τα μεγέθη συναλλαγών που καθορίζονται σύμφωνα με τις παραγράφους 2 και 3 στον αντίστοιχο αριθμό μονάδων διαπραγμάτευσης, όπως ορίζεται εκ των προτέρων από τον εν λόγω τόπο διαπραγμάτευσης για την αντίστοιχη υποκατηγορία περιουσιακών στοιχείων. Οι φορείς της αγοράς και οι επιχειρήσεις επενδύσεων που διαχειρίζονται έναν τόπο διαπραγμάτευσης μπορούν να διατηρούν τα εν λόγω μεγέθη συναλλαγών έως την εφαρμογή των αποτελεσμάτων των επόμενων υπολογισμών που διενεργούνται σύμφωνα με την παράγραφο 17.

10. Οι υπολογισμοί που αναφέρονται στην παράγραφο 2 στοιχείο β) περίπτωση i) στην παράγραφο 3 στοιχείο β) εξαιρούν τις συναλλαγές μεγέθους ίσου ή μικρότερου από 100 000 ευρώ.

11. Για τους σκοπούς των προσδιορισμών που αναφέρονται στις παραγράφους 2 και 3, η παράγραφος 2 στοιχείο β) και η παράγραφος 3 στοιχεία β), γ) και δ) δεν εφαρμόζονται όταν ο αριθμός των συναλλαγών που λαμβάνεται υπόψη για τους υπολογισμούς είναι μικρότερος από 1 000· σε αυτήν την περίπτωση εφαρμόζονται τα ακόλουθα όρια:

α) 100 000 ευρώ για όλα τα είδη ομολογιών πλην των ETC και ETN·

β) οι οριακές τιμές που ορίζονται στην παράγραφο 2 στοιχείο α) και στην παράγραφο 3 στοιχείο α) για όλα τα χρηματοπιστωτικά μέσα που δεν καλύπτονται από το στοιχείο α) της εν λόγω παραγράφου.

▼B

12. Εκτός από την περίπτωση κατά την οποία αναφέρονται σε δικαιώματα εκπομπών ή παραγώγων, οι υπολογισμοί που αναφέρονται στην παράγραφο 2 στοιχείο β) και στην παράγραφο 3 στοιχεία β), γ) και δ) στρογγυλοποιούνται στις επόμενες:

α) 100 000 όταν η οριακή τιμή είναι μικρότερη από 1 εκατομμύριο·

β) 500 000 όταν η οριακή τιμή είναι ίση ή μεγαλύτερη από 1 εκατομμύριο αλλά μικρότερη από 10 εκατομμύρια·

γ) 5 εκατομμύρια όταν η οριακή τιμή είναι ίση ή μεγαλύτερη από 10 εκατομμύρια αλλά μικρότερη από 100 εκατομμύρια·

δ) 25 εκατομμύρια όταν η οριακή τιμή είναι ίση ή μεγαλύτερη από 100 εκατομμύρια.

13. Για τους σκοπούς της παραγράφου 1, τα ποσοτικά κριτήρια ρευστότητας που ορίζονται για κάθε κατηγορία περιουσιακών στοιχείων στο παράρτημα III καθορίζονται σύμφωνα με το τμήμα 1 του παραρτήματος III.

14. Για παράγωγα επί μετοχών που εισάγονται προς διαπραγμάτευση ή τέλεσαν υπό διαπραγμάτευση σε τόπο διαπραγμάτευσης για πρώτη φορά, τα οποία δεν ανήκουν σε υποκατηγορία για την οποία το συγκεκριμένο μέγεθος ανά πιστωτικό μέσο που αναφέρεται στο άρθρο 5 και στο άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο γ) και το μέγεθος των εντολών και των συναλλαγών μεγάλης κλίμακας σε σύγκριση με τον συνήθη όγκο συναλλαγών που αναφέρεται στο άρθρο 3 και στο άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο α) έχουν δημοσιοποιηθεί και τα οποία ανήκουν σε μία από τις υποκατηγορίες περιουσιακών στοιχείων που ορίζονται στην παράγραφο 1 στοιχείο α) περίπτωση ii), το συγκεκριμένο μέγεθος ανά χρηματοπιστωτικό μέσο και το μέγεθος των εντολών και των συναλλαγών μεγάλης κλίμακας σε σύγκριση με τον συνήθη όγκο συναλλαγών είναι αυτά που ισχύουν για τη μικρότερη ζώνη του μέσου ημερήσιου ονομαστικού ποσού (ADNA) της υποκατηγορίας περιουσιακών στοιχείων στην οποία ανήκει το παράγωγο επί μετοχών.

15. Τα χρηματοπιστωτικά μέσα που εισάγονται προς διαπραγμάτευση ή τέλεσαν υπό διαπραγμάτευση σε τόπο διαπραγμάτευσης για πρώτη φορά, τα οποία δεν ανήκουν σε οποιαδήποτε κατηγορία για την οποία το συγκεκριμένο μέγεθος ανά χρηματοπιστωτικό μέσο που αναφέρεται στο άρθρο 5 και στο άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο γ) και το μέγεθος των εντολών και των συναλλαγών μεγάλης κλίμακας σε σύγκριση με τον συνήθη όγκο των συναλλαγών που αναφέρεται στο άρθρο 3 και στο άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο α) έχουν δημοσιοποιηθεί, θεωρείται ότι δεν έχουν ρευστή αγορά έως την εφαρμογή των αποτελεσμάτων των υπολογισμών που εκτελούνται σύμφωνα με την παράγραφο 17. Το εφαρμοστέο συγκεκριμένο μέγεθος ανά χρηματοπιστωτικό μέσο που αναφέρεται στο άρθρο 5 και στο άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο γ) και το μέγεθος των εντολών και των συναλλαγών μεγάλης κλίμακας σε σύγκριση με τον συνήθη όγκο των συναλλαγών που αναφέρεται στο άρθρο 3 και στο άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο α) είναι αυτά των υποκατηγοριών που προσδιορίζεται ότι δεν έχουν ρευστή αγορά τα οποία ανήκουν στην ίδια υποκατηγορία περιουσιακών στοιχείων.

16. Μετά από το τέλος της ημέρας διαπραγμάτευσης αλλά πριν το τέλος της εν λόγω ημέρας, οι τόποι διαπραγμάτευσης υποβάλλουν στις αρμόδιες αρχές τα λεπτομερή στοιχεία που περιλαμβάνονται στο παράρτημα IV για την εκτέλεση των υπολογισμών που αναφέρονται στην παράγραφο 5, κάθε φορά που το χρηματοπιστωτικό μέσο εισάγεται προς διαπραγμάτευση ή τελεί για πρώτη φορά υπό διαπραγμάτευση στον εν λόγω τόπο διαπραγμάτευσης ή κάθε φορά που μεταβάλλονται τα λεπτομερή στοιχεία που έχουν υποβληθεί στο παρελθόν.

17. Οι αρμόδιες αρχές εξασφαλίζουν τη δημοσιοποίηση των αποτελεσμάτων των υπολογισμών που αναφέρονται στην παράγραφο 5 για κάθε χρηματοπιστωτικό μέσο και κατηγορία χρηματοπιστωτικού μέσου

▼B

έως τις 30 Απριλίου του έτους που έπεται της ημερομηνίας εφαρμογής του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 και έως τις 30 Απριλίου κάθε επόμενου έτους. Τα εν λόγω αποτελέσματα των υπολογισμών εφαρμόζονται από την 1η Ιουνίου κάθε έτους μετά τη δημοσιοποίηση.

18. Για τους σκοπούς των υπολογισμών της παραγράφου 1 στοιχείο β) περίπτωση i) και κατά παρέκκλιση από τις παραγράφους 7, 15 και 17, οι αρμόδιες αρχές, όσον αφορά τις ομολογίες πλην των ETC και των ETN, διασφαλίζουν τη δημοσιοποίηση των υπολογισμών που αναφέρονται στην παράγραφο 5 στοιχείο α) σε τριμηνιαία βάση, την πρώτη ημέρα του Φεβρουαρίου, Μαΐου, Αυγούστου και Νοεμβρίου μετά την ημερομηνία εφαρμογής του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 και την πρώτη ημέρα του Φεβρουαρίου, Μαΐου, Αυγούστου και Νοεμβρίου κάθε επόμενο έτος. Οι υπολογισμοί περιλαμβάνουν συναλλαγές που εκτελούνται στην Ένωση κατά το προηγούμενο ημερολογιακό τρίμηνο και ισχύουν για την τριμηνιαία περίοδο που αρχίζει από την δέκατη έκτη ημέρα του Φεβρουαρίου, Μαΐου, Αυγούστου και Νοεμβρίου κάθε έτους.

19. Οι ομολογίες, πλην των ETC και των ETN, που έχουν εισαχθεί προς διαπραγμάτευση ή τέλεσαν υπό διαπραγμάτευση σε τόπο διαπραγμάτευσης για πρώτη φορά κατά τη διάρκεια των δύο πρώτων μηνών του τριμήνου θεωρείται πως έχουν ρευστή αγορά όπως ορίζεται στον Πίνακα 2.2 του παραρτήματος III έως την εφαρμογή των αποτελεσμάτων του υπολογισμού του ημερολογιακού τριμήνου.

20. Οι ομολογίες, πλην των ETC και των ETN, που έχουν εισαχθεί προς διαπραγμάτευση ή τέλεσαν υπό διαπραγμάτευση σε τόπο διαπραγμάτευσης για πρώτη φορά κατά τη διάρκεια του τελευταίου μήνα του τριμήνου θεωρείται πως έχουν ρευστή αγορά όπως ορίζεται στον Πίνακα 2.2 του παραρτήματος III έως την εφαρμογή των αποτελεσμάτων του υπολογισμού του επόμενου ημερολογιακού τριμήνου.

Άρθρο 14

Συναλλαγές για τις οποίες ισχύει η εξαίρεση του άρθρου 1 παράγραφος 6 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014

[άρθρο 1 παράγραφος 6 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014]

Μια συναλλαγή θεωρείται ότι έχει συναφθεί από μέλος του Ευρωπαϊκού Συστήματος Κεντρικών Τραπεζών (ΕΣΚΤ) κατά την εφαρμογή της νομισματικής και συναλλαγματικής πολιτικής καθώς και της πολιτικής χρηματοπιστωτικής σταθερότητας όταν η εν λόγω συναλλαγή πληροί οποιαδήποτε από τις ακόλουθες προϋποθέσεις:

α) η συναλλαγή πραγματοποιείται για τους σκοπούς της νομισματικής πολιτικής, συμπεριλαμβανομένης μιας πράξης που εκτελείται σύμφωνα με τα άρθρα 18 και 20 του καταστατικού του Ευρωπαϊκού Συστήματος Κεντρικών Τραπεζών (ΕΣΚΤ) και της Ευρωπαϊκής Κεντρικής Τράπεζας το οποίο αποτελεί παράρτημα της Συνθήκης για την Ευρωπαϊκή Ένωση ή μιας πράξης που εκτελείται βάσει αντίστοιχων εθνικών διατάξεων για μέλη του ΕΣΚΤ στα κράτη μέλη των οποίων το νόμισμα δεν είναι το ευρώ·

β) η συναλλαγή είναι μια συναλλαγματική πράξη, συμπεριλαμβανομένων των πράξεων που εκτελούνται για την τήρηση ή τη διαχείριση επίσημων συναλλαγματικών αποθεμάτων των κρατών μελών ή την υπηρεσία διαχείρισης αποθεμάτων που παρέχεται από ένα μέλος του ΕΣΚΤ στις κεντρικές τράπεζες σε άλλες χώρες, της οποίας η εξαίρεση έχει επεκταθεί σύμφωνα με το άρθρο 1 παράγραφος 9 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014·

γ) η συναλλαγή πραγματοποιείται για τους σκοπούς της πολιτικής χρηματοπιστωτικής σταθερότητας.

▼B

Άρθρο 15

Συναλλαγές για τις οποίες δεν ισχύει η εξαίρεση του άρθρου 1 παράγραφος 6 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014

[άρθρο 1 παράγραφος 7 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014]

Το άρθρο 1 παράγραφος 6 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 δεν ισχύει για τα ακόλουθα είδη συναλλαγών που συνάπτονται από ένα μέλος του ΕΣΚΤ για την εκτέλεση μιας επενδυτικής πράξης που δεν συνδέεται με την εκτέλεση από το εν λόγω μέλος ενός από τα καθήκοντα που αναφέρονται στο άρθρο 14:

α) συναλλαγές που συνάπτονται για τη διαχείριση των ίδιων κεφαλαίων του·

β) συναλλαγές που συνάπτονται για διοικητικούς σκοπούς για το προσωπικό του μέλους του ΕΣΚΤ, οι οποίες περιλαμβάνουν συναλλαγές που πραγματοποιούνται με την ιδιότητα του διαχειριστή συνταξιοδοτικού καθεστώτος για το προσωπικό του·

γ) συναλλαγές που συνάπτονται για το χαρτοφυλάκιο επενδύσεών του σύμφωνα με υποχρεώσεις βάσει της εθνικής νομοθεσίας.

Άρθρο 16

Προσωρινή αναστολή υποχρεώσεων διαφάνειας

[Άρθρο 9 παράγραφος 5 στοιχείο α) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014]

1. Για χρηματοπιστωτικά μέσα για τα οποία υπάρχει ρευστή αγορά σύμφωνα με τη μεθοδολογία που ορίζεται στο άρθρο 13, μια αρμόδια αρχή μπορεί προσωρινά να αναστείλει τις υποχρεώσεις που ορίζονται στο άρθρο 8 και 10 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 όπου για μια κατηγορία ομολογιών, δομημένων χρηματοπιστωτικών προϊόντων, δικαιωμάτων εκπομπής και παραγώγων, ο συνολικός όγκος όπως ορίζεται στον πίνακα 4 του παραρτήματος ΙΙ που υπολογίζεται για τις προηγούμενες 30 ημερολογιακές ημέρες αντιπροσωπεύει λιγότερο από το 40 % του μέσου μηνιαίου όγκου που υπολογίζεται για τους 12 πλήρεις ημερολογιακούς μήνες που προηγούνται των εν λόγω 30 ημερολογιακών ημερών.

2. Για χρηματοπιστωτικά μέσα για τα οποία δεν υπάρχει ρευστή αγορά σύμφωνα με τη μεθοδολογία που ορίζεται στο άρθρο 13, μια αρμόδια αρχή μπορεί προσωρινά να αναστείλει τις υποχρεώσεις που αναφέρονται στο άρθρο 8 και 10 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 όταν για μια κατηγορία ομολογιών, δομημένων χρηματοπιστωτικών προϊόντων, δικαιωμάτων εκπομπής και παραγώγων, ο συνολικός όγκος όπως ορίζεται στον πίνακα 4 του παραρτήματος ΙΙ που υπολογίζεται για τις προηγούμενες 30 ημερολογιακές ημέρες αντιπροσωπεύει λιγότερο από το 20 % του μέσου μηνιαίου όγκου που υπολογίζεται για τους 12 πλήρεις ημερολογιακούς μήνες που προηγούνται των εν λόγω 30 ημερολογιακών ημερών.

3. Οι αρμόδιες αρχές λαμβάνουν υπόψη τους τις συναλλαγές που εκτελούνται σε όλους τους τόπους στην Ένωση για την κατηγορία σχετικών ομολογιών, δομημένων χρηματοπιστωτικών προϊόντων, δικαιωμάτων εκπομπής και παραγώγων κατά την εκτέλεση των υπολογισμών που αναφέρονται στις παραγράφους 1 και 2. Οι υπολογισμοί πραγματοποιούνται στο επίπεδο της κατηγορίας χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία ισχύει η δοκιμασία ρευστότητας που ορίζεται στο άρθρο 13.

4. Πριν οι αρμόδιες αρχές αποφασίσουν να αναστείλουν τις υποχρεώσεις διαφάνειας, διασφαλίζουν ότι η σημαντική μείωση της ρευστότητας σε όλους τους τόπους δεν είναι το αποτέλεσμα εποχικών επιπτώσεων της αντίστοιχης κατηγορίας χρηματοπιστωτικών μέσων στη ρευστότητα.

▼B

Άρθρο 17

Διατάξεις για την αξιολόγηση της ρευστότητας για ομολογίες και για τον προσδιορισμό του συγκεκριμένου προσυναλλακτικού μεγέθους ανά όριο του χρηματοπιστωτικού μέσου βάσει εκατοστημορίων συναλλαγών

1. Για τον προσδιορισμό των ομολογιών για τις οποίες δεν υπάρχει ρευστή αγορά για τους σκοπούς του άρθρου 6 και σύμφωνα με τη μεθοδολογία που ορίζεται στο άρθρο 13 παράγραφος 1 στοιχείο β), η προσέγγιση για το κριτήριο ρευστότητας «μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών» πρέπει να υιοθετείται εφαρμόζοντας τον «μέσο ημερήσιο αριθμό συναλλαγών» που αντιστοιχεί στο στάδιο S1 (15 ημερήσιες συναλλαγές).

2. Οι εταιρικές ομολογίες και οι καλυμμένες ομολογίες που έχουν εισαχθεί προς διαπραγμάτευση ή τέλεσαν υπό διαπραγμάτευση σε τόπο διαπραγμάτευσης για πρώτη φορά πρέπει να θεωρείται ότι έχουν ρευστή αγορά μέχρι την εφαρμογή των αποτελεσμάτων του πρώτου τριμηνιαίου προσδιορισμού ρευστότητας όπως ορίζεται στο άρθρο 13 παράγραφος 18 όπου:

α) το μέγεθος έκδοσης υπερβαίνει τα 1 000 000 000 ευρώ κατά τα στάδια S1 και S2, όπως καθορίζεται σύμφωνα με την παράγραφο 6·

β) το μέγεθος έκδοσης υπερβαίνει τα 500 000 000 ευρώ κατά τα στάδια S3 και S4, όπως καθορίζεται σύμφωνα με την παράγραφο 6·

3. Για τον προσδιορισμό του συγκεκριμένου μεγέθους ανά χρηματοπιστωτικό μέσο για τους σκοπούς του άρθρου 5 και σύμφωνα με τη μεθοδολογία που ορίζεται στο άρθρο 13 παράγραφος 2 στοιχείο β), η προσέγγιση για το εκατοστημόριο συναλλαγών που πρέπει να εφαρμοστεί χρησιμοποιείται με την εφαρμογή του εκατοστημορίου συναλλαγών που αντιστοιχεί στο στάδιο S1 (30ό εκατοστημόριο).

4. Η ΕΑΚΑΑ, έως τις 30 Ιουλίου του έτους που έπεται της ημερομηνίας εφαρμογής του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 και έως τις 30 Ιουλίου κάθε επόμενου έτους, υποβάλλει στην Επιτροπή μια αξιολόγηση της λειτουργίας των ορίων για το κριτήριο ρευστότητας «μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών» για ομολογίες, καθώς και τα εκατοστημόρια συναλλαγών που προσδιορίζουν το ειδικό μέγεθος των χρηματοπιστωτικών μέσων που καλύπτονται από την παράγραφο 8. Η υποχρέωση να υποβληθεί η αξιολόγηση της λειτουργίας των ορίων για το κριτήριο ρευστότητας για ομολογίες παύει να ισχύει μόλις επιτευχθεί το επίπεδο S4 στην ακολουθία της παραγράφου 6. Η υποχρέωση να υποβληθεί η αξιολόγηση για τα εκατοστημόρια συναλλαγών παύει να ισχύει μόλις επιτευχθεί το επίπεδο S4 στην ακολουθία της παραγράφου 6.

5. Η αξιολόγηση που αναφέρεται στην παράγραφο 4 λαμβάνει υπόψη:

α) την εξέλιξη του όγκου των συναλλαγών σε μη μετοχικά χρηματοπιστωτικά μέσα που καλύπτονται από τις υποχρεώσεις προσυναλλακτικης διαφάνειας σύμφωνα με το άρθρο 8 και το άρθρο 9 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014·

β) τις επιπτώσεις για τους παρόχους ρευστότητας των ορίων εκατοστημορίων που χρησιμοποιούνται για τον καθορισμό του συγκεκριμένου μεγέθους ανά χρηματοπιστωτικό μέσο· και

γ) άλλους σχετικούς παράγοντες.

6. Η ΕΑΚΑΑ, στο πλαίσιο της αξιολόγησης που διενεργείται σύμφωνα με τις παραγράφους 4 και 5, υποβάλλει στην Επιτροπή μια επικαιροποιημένη έκδοση του ρυθμιστικού τεχνικού προτύπου για την προσαρμογή του ορίου για το κριτήριο ρευστότητας «μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών» για ομολογίες, σύμφωνα με την παρακάτω ακολουθία:

▼B

α) S2 (10 ημερήσιες συναλλαγές) έως τις 30 Ιουλίου του έτους που έπεται της ημερομηνίας εφαρμογής του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014·

β) S3 (7 ημερήσιες συναλλαγές) έως τις 30 Ιουλίου του επόμενου έτους· και

γ) S4 (2 ημερήσιες συναλλαγές) έως τις 30 Ιουλίου του επόμενου έτους.

7. Όταν η ΕΑΚΑΑ δεν υποβάλλει τροποποιημένο ρυθμιστικό τεχνικό πρότυπο για την προσαρμογή του ορίου στο επόμενο στάδιο σύμφωνα με την ακολουθία που αναφέρεται στην παράγραφο 6, η αξιολόγηση της ΕΑΚΑΑ που πραγματοποιείται σύμφωνα με τις παραγράφους 4 και 5 εξηγεί γιατί δεν δικαιολογείται η προσαρμογή του ορίου στο σχετικό επόμενο στάδιο. Σε αυτήν την περίπτωση, η μετάβαση στο επόμενο στάδιο θα αναβληθεί για ένα έτος.

8. Η ΕΑΚΑΑ, στο πλαίσιο της αξιολόγησης που διενεργείται σύμφωνα με τις παραγράφους 4 και 5, υποβάλλει στην Επιτροπή μια επικαιροποιημένη έκδοση του ρυθμιστικού τεχνικού προτύπου για την προσαρμογή του ορίου για τα εκατοστημόρια συναλλαγών, σύμφωνα με την παρακάτω ακολουθία:

α) S2 (40ό εκατοστημόριο) έως τις 30 Ιουλίου του έτους που έπεται της ημερομηνίας εφαρμογής του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014·

β) S3 (50ό εκατοστημόριο) έως τις 30 Ιουλίου του επόμενου έτους· και

γ) S4 (60ό εκατοστημόριο) έως τις 30 Ιουλίου του επόμενου έτους.

9. Όταν η ΕΑΚΑΑ δεν υποβάλλει τροποποιημένο ρυθμιστικό τεχνικό πρότυπο για την προσαρμογή του ορίου στο επόμενο στάδιο σύμφωνα με την ακολουθία που αναφέρεται στην παράγραφο 8, η αξιολόγηση της ΕΑΚΑΑ που πραγματοποιείται σύμφωνα με τις παραγράφους 4 και 5 εξηγεί γιατί δεν δικαιολογείται η προσαρμογή του ορίου στο σχετικό επόμενο στάδιο. Σε αυτήν την περίπτωση, η μετάβαση στο επόμενο στάδιο θα αναβληθεί για ένα έτος.

Άρθρο 18

Μεταβατικές διατάξεις

1. Οι αρμόδιες αρχές, το αργότερο έξι μήνες πριν από την ημερομηνία εφαρμογής του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, συγκεντρώνουν τα απαραίτητα δεδομένα, υπολογίζουν και εξασφαλίζουν τη δημοσίευση των στοιχείων που αναφέρονται στο άρθρο 13 παράγραφος 5.

2. Για τους σκοπούς της παραγράφου 1:

α) οι υπολογισμοί βασίζονται σε μία εξάμηνη περίοδο αναφοράς η οποία αρχίζει 18 μήνες πριν από την ημερομηνία εφαρμογής του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014·

β) τα αποτελέσματα των υπολογισμών που περιλαμβάνονται στην πρώτη δημοσίευση χρησιμοποιούνται έως την εφαρμογή των αποτελεσμάτων των πρώτων τακτικών υπολογισμών που ορίζονται στο άρθρο 13 παράγραφος 17.

3. Κατά παρέκκλιση από την παράγραφο 1, για όλες τις ομολογίες, εκτός από τις ETC και ETN, οι αρμόδιες αρχές καταβάλλουν κάθε δυνατή προσπάθεια να εξασφαλίσουν τη δημοσίευση των αποτελεσμάτων των υπολογισμών διαφάνειας που ορίζονται στο άρθρο 13 παράγραφος 1 στοιχείο β) περίπτωση i) το αργότερο την πρώτη ημέρα του μήνα που προηγείται της ημερομηνίας εφαρμογής του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014, βάσει μιας τρίμηνης περιόδου αναφοράς που αρχίζει την πρώτη ημέρα του πέμπτου μήνα που προηγείται της ημερομηνίας εφαρμογής του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014.

▼B

4. Οι αρμόδιες αρχές, οι φορείς της αγοράς και οι επιχειρήσεις επενδύσεων, συμπεριλαμβανομένων των επιχειρήσεων επενδύσεων που διαχειρίζονται έναν τόπο διαπραγμάτευσης χρησιμοποιούν τις πληροφορίες που δημοσιοποιούνται σύμφωνα με την παράγραφο 3 έως την εφαρμογή των αποτελεσμάτων του πρώτου τακτικού υπολογισμού που ορίζεται στο άρθρο 13 παράγραφος 18.

5. Οι ομολογίες, πλην των ETC και των ETN, τα οποία έχουν εισαχθεί προς διαπραγμάτευση ή τέλεσαν υπό διαπραγμάτευση σε τόπο διαπραγμάτευσης για πρώτη φορά κατά την τρίμηνη περίοδο που προηγήθηκε την ημερομηνία εφαρμογής του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 θεωρείται ότι δεν έχουν ρευστή αγορά όπως ορίζεται στον Πίνακα 2.2 του παραρτήματος III έως την εφαρμογή των αποτελεσμάτων του πρώτου τακτικού υπολογισμού που ορίζεται στο άρθρο 13 παράγραφος 18.

Άρθρο 19

Έναρξη ισχύος και εφαρμογή

Ο παρών κανονισμός αρχίζει να ισχύει την εικοστή ημέρα από τη δημοσίευσή του στην *Επίσημη Εφημερίδα της Ευρωπαϊκής Ένωσης*.

Εφαρμόζεται από τις 3 Ιανουαρίου 2018.

Ο παρών κανονισμός είναι δεσμευτικός ως προς όλα τα μέρη του και ισχύει άμεσα σε κάθε κράτος μέλος.

▼B

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ Ι

Περιγραφή του είδους του συστήματος και των συναφών πληροφοριών που πρέπει να δημοσιοποιούνται σύμφωνα με το άρθρο 2

Πληροφορίες που πρέπει να δημοσιοποιούνται σύμφωνα με το άρθρο 2

Είδος συστήματος	Περιγραφή του συστήματος	Πληροφορίες που πρέπει να δημοσιοποιούνται
Σύστημα συνεχούς διαπραγμάτευσης βάσει βιβλίου εντολών	Σύστημα το οποίο, μέσω βιβλίου εντολών και αλγορίθμου διαπραγμάτευσης που λειτουργεί χωρίς ανθρώπινη παρέμβαση, αντιστοιχίζει τις εντολές πώλησης με εντολές αγοράς βάσει της καλύτερης διαθέσιμης τιμής σε συνεχή βάση.	Για κάθε χρηματοπιστωτικό μέσο, ο αθροιστικός αριθμός εντολών και ο όγκος που αντιπροσωπεύουν σε κάθε επίπεδο τιμής, τουλάχιστον για τα πέντε καλύτερα επίπεδα τιμών αγοράς και πώλησης.
Σύστημα διαπραγμάτευσης βάσει προσφορών (ζευγών εντολών)	Σύστημα στο οποίο οι συναλλαγές συνάπτονται με βάση δεσμευτικά ζεύγη εντολών που τίθενται σε συνεχή βάση στη διάθεση των συμμετεχόντων, και το οποίο υποχρεώνει τους ειδικούς διαπραγματευτές να διατηρούν ζεύγη εντολών σε μέγεθος που εξισορροπεί την ανάγκη των μελών και των συμμετεχόντων να διαπραγματεύονται σε εμπορικά μεγέθη, αφενός, με τον κίνδυνο στον οποίο εκτίθεται ο ίδιος ο ειδικός διαπραγματευτής, αφετέρου.	Για κάθε χρηματοπιστωτικό μέσο, η καλύτερη τιμή αγοράς και πώλησης για κάθε ειδικό διαπραγματευτή του εν λόγω μέσου, μαζί με τους όγκους που συνδέονται με αυτές τις τιμές. Τα ζεύγη εντολών που δημοσιοποιούνται είναι εκείνα που αντιπροσωπεύουν δεσμευτικές προσφορές αγοράς και πώλησης των χρηματοπιστωτικών μέσων και που περιλαμβάνουν την τιμή και τον όγκο των χρηματοπιστωτικών μέσων στην οποία/στον οποίο είναι διατεθειμένοι να αγοράσουν ή να πωλήσουν οι εγγεγραμμένοι ειδικοί διαπραγματευτές. Σε εξαιρετικές συνθήκες αγοράς, ωστόσο, μπορούν να επιτρέπονται ενδεικτικές τιμές ή τιμές μόνον πώλησης ή μόνον αγοράς για περιορισμένο χρονικό διάστημα.
Σύστημα διαπραγμάτευσης με περιοδική δημοπρασία	Σύστημα το οποίο αντιστοιχίζει εντολές βάσει περιοδικής δημοπρασίας και αλγορίθμου διαπραγμάτευσης που λειτουργεί χωρίς ανθρώπινη παρέμβαση.	Για κάθε χρηματοπιστωτικό μέσο, η τιμή στην οποία το σύστημα διαπραγμάτευσης με δημοπρασία θα ικανοποιούσε με τον καλύτερο δυνατό τρόπο τον αλγόριθμο διαπραγμάτευσής του και τον όγκο που ενδεχομένως θα ήταν εκτελέσιμος στην τιμή αυτή από τους συμμετέχοντες στο σύστημα αυτό.
Σύστημα διαπραγμάτευσης με αίτηση προσδιορισμού τιμής	Σύστημα διαπραγμάτευσης όπου παρέχεται προσφορά τιμής ή τιμών εις απάντηση σε αίτηση προσδιορισμού τιμής που υποβάλλεται από ένα ή περισσότερα άλλα μέλη ή συμμετέχοντες. Η προσφορά είναι εκτελέσιμη αποκλειστικά από το μέλος ή τον συμμετέχοντα στην αγορά που υπέβαλε την αίτηση. Το μέλος ή ο συμμετέχων που υπέβαλε την αίτηση μπορεί να συνάψει συναλλαγή με την αποδοχή της προσφοράς τιμής ή τιμών που του υποβλήθηκε κατόπιν αιτήσεως.	Οι προσφορές τιμής και οι συνδεόμενοι όγκοι από οποιοδήποτε μέλος ή συμμετέχοντα, που, εάν υπάρξει αποδοχή τους, θα οδηγούσαν σε συναλλαγή βάσει των κανόνων του συστήματος. Όλες οι υποβληθείσες προσφορές τιμής εις απάντηση σε αίτηση προσδιορισμού τιμής μπορούν να δημοσιεύονται ταυτοχρόνως, αλλά όχι αργότερα από τη στιγμή που καθίστανται εκτελέσιμες.
Σύστημα προφορικής διαπραγμάτευσης	Σύστημα διαπραγμάτευσης στο οποίο οι συναλλαγές μεταξύ των μελών κανονίζονται μέσω προφορικής διαπραγμάτευσης.	Οι προσφορές αγοράς και πώλησης και οι συνδεόμενοι όγκοι από οποιοδήποτε μέλος ή συμμετέχοντα, που, εάν υπάρξει αποδοχή τους, θα οδηγούσαν σε συναλλαγή βάσει των κανόνων του συστήματος.
Σύστημα διαπραγμάτευσης που δεν εμπίπτει στις πρώτες 5 γραμμές	Υβριδικό σύστημα που εμπίπτει σε τουλάχιστον δύο από τις πρώτες πέντε γραμμές ή σύστημα στο οποίο η διαδικασία προσδιορισμού της τιμής είναι διαφορετικής φύσεως από εκείνη που εφαρμόζεται στα είδη συστημάτων που εμπίπτουν στις πρώτες πέντε γραμμές.	Επαρκείς πληροφορίες ως προς το επίπεδο εντολών ή ζευγών εντολών και του συναλλακτικού ενδιαφέροντος· ειδικότερα, τα πέντε καλύτερα επίπεδα τιμών αγοράς και πώλησης και/ή ζεύγη εντολών για κάθε ειδικό διαπραγματευτή στο μέσο, εφόσον το επιτρέπουν τα χαρακτηριστικά του μηχανισμού διαμόρφωσης της τιμής.

▼B

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ ΙΙ

Λεπτομέρειες για τις συναλλαγές που πρέπει να δημοσιοποιούνται

Πίνακας 1

Πίνακας συμβόλων για τον πίνακα 2

ΣΥΜΒΟΛΟ	ΤΥΠΟΣ ΔΕΔΟΜΕΝΩΝ	ΟΡΙΣΜΟΣ
{ALPHANUM-n}	Έως n αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Πεδίο με ελεύθερο κείμενο.
{CURRENCYCODE_3}	3 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Κωδικός νομίσματος με 3 γράμματα, όπως ορίζεται στους κωδικούς νομίσματος ISO 4217
{DATE_TIME_FORMAT}	Μορφότυπος ημερομηνίας και ώρας ISO 8601	Ημερομηνία και ώρα με τον ακόλουθο μορφότυπο: YYYY-MM-DDThh:mm:ss.dddddd Z. Όπου: — «YYYY» είναι το έτος· — «MM» είναι ο μήνας· — «DD» είναι η ημέρα· — «T» — σημαίνει ότι πρέπει να χρησιμοποιείται το γράμμα «T» — «hh» είναι η ώρα· — «mm» είναι το λεπτό· — «ss.dddddd» είναι το δευτερόλεπτο και το κλάσμα δευτερολέπτου· — Z είναι η συντονισμένη παγκόσμια ώρα UTC. Οι ημερομηνίες και οι ώρες πρέπει να αναφέρονται σε UTC.
{DECIMAL-n/m}	Δεκαδικός αριθμός με το πολύ n ψηφία συνολικά, εκ των οποίων το πολύ m ψηφία μπορεί να είναι κλασματικά ψηφία.	Αριθμητικό πεδίο τόσο για θετικές όσο και για αρνητικές τιμές: — σημείο υποδιαστολής:«.» (τελεία)· — οι αρνητικοί αριθμοί έχουν πρόσημο «-» (μείον). Κατά περίπτωση, οι τιμές στρογγυλεύονται χωρίς αποκοπή.
{ISIN}	12 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Κωδικός ISIN, όπως ορίζεται στο ISO 6166
{MIC}	4 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Αναγνωριστικός κωδικός αγοράς, όπως ορίζεται στο ISO 10383

Πίνακας 2

Κατάλογος λεπτομερειών για τους σκοπούς μετασυναλλακτικής διαφάνειας

Λεπτομέρειες	Χρηματοπιστωτικά μέσα	Περιγραφή/Λεπτομέρειες που πρέπει να δημοσιεύονται	Είδος τόπου εκτέλεσης/ δημοσίευσης	Μορφότυπος που πρέπει να συμπληρώνεται όπως ορίζεται στον πίνακα 1
Ημερομηνία και ώρα διαπραγμάτευσης	Για όλα τα χρηματοπιστωτικά μέσα	Ημερομηνία και ώρα κατά την οποία εκτελέστηκε η συναλλαγή.	Ρυθμιζόμενη αγορά (RM), Πολυμερής μηχανισμός διαπραγμάτευσης — ΠΜΔ (MTF), Μηχανισμός οργανωμένης διαπραγμάτευσης — ΜΟΔ (OTF)	{DATE_TIME_FORMAT}

▼B

Λεπτομέρειες	Χρηματοπιστωτικά μέσα	Περιγραφή/Λεπτομέρειες που πρέπει να δημοσιεύονται	Είδος τόπου εκτέλεσης/ δημοσίευσης	Μορφότυπος που πρέπει να συμπληρώνεται όπως ορίζεται στον πίνακα 1
		Για συναλλαγές που εκτελούνται σε τόπο διαπραγμάτευσης, το επίπεδο λεπτομέρειας προσδιορίζεται σύμφωνα με τις απαιτήσεις που καθορίζονται στο άρθρο 3 του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/574 της Επιτροπής ([1]). Για συναλλαγές που δεν εκτελούνται σε τόπο διαπραγμάτευσης, αναφέρεται η ημερομηνία και η ώρα όταν τα μέρη συμφωνούν για το περιεχόμενο των ακόλουθων πεδίων: ποσότητα, τιμή, νομίσματα (στα πεδία 31, 34 και 40, όπως προσδιορίζονται στον πίνακα 2 του παραρτήματος I του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/590, αναγνωριστικός κωδικός μέσου, κατάταξη του μέσου και κωδικός υποκείμενου μέσου, κατά περίπτωση. Για συναλλαγές που δεν εκτελούνται σε τόπο διαπραγμάτευσης, η ώρα αναφέρεται με ακρίβεια προσέγγισης τουλάχιστον δευτερολέπτου. Όταν η συναλλαγή προκύπτει από εντολή που διαβιβάστηκε από την εκτελεστική επιχείρηση για λογαριασμό πελάτη σε τρίτο μέρος, και δεν πληρούνταν οι προϋποθέσεις διαβίβασης που καθορίζονται στο άρθρο 5 του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/590, πρόκειται για την ημερομηνία και την ώρα της συναλλαγής παρά για την ώρα της διαβίβασης της εντολής.	Εγκεκριμένος μηχανισμός δημοσίευσης — ΕΜΔ (APA) Πάροχος ενοποιημένου δελτίου — ΠΕΔ (CTP)	
Είδος αναγνωριστικού κωδικού μέσου	Για όλα τα χρηματοπιστωτικά μέσα	Είδος κωδικού που χρησιμοποιείται για τον προσδιορισμό του χρηματοπιστωτικού μέσου	RM, MTF, OTF APA CTP	«ISIN» = κωδικός ISIN, εάν υπάρχει ISIN «OTHR» = άλλος αναγνωριστικός κωδικός
Αναγνωριστικός κωδικός μέσου	Για όλα τα χρηματοπιστωτικά μέσα	Κωδικός που χρησιμοποιείται για τον προσδιορισμό του χρηματοπιστωτικού μέσου.	RM, MTF, OTF APA CTP	{ISIN} Όταν ένας αναγνωριστικός κωδικός μέσου δεν είναι ISIN, αναγνωριστικός κωδικός που προσδιορίζει το παράγωγο μέσο με βάση τα πεδία 3 έως 5, 7 και 8 και 12 έως 42, όπως ορίζεται στο παράρτημα IV, και τα πεδία 13 και 24 έως 48, όπως ορίζεται στο παράρτημα του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/585, και η ομαδοποίηση των παράγωγων μέσων, όπως ορίζεται στο παράρτημα III.

▼B

Λεπτομέρειες	Χρηματοπιστωτικά μέσα	Περιγραφή/Λεπτομέρειες που πρέπει να δημοσιεύονται	Είδος τόπου εκτέλεσης/ δημοσίευσης	Μορφότυπος που πρέπει να συμπληρώνεται όπως ορίζεται στον πίνακα 1
Τιμή	Για όλα τα χρηματοπιστωτικά μέσα	Η τιμή διαπραγμάτευσης της συναλλαγής, εξαιρουμένων προμηθειών και δεδουλευμένων τόκων, κατά περίπτωση. Στην περίπτωση συμβολαίων δικαιωμάτων προαίρεσης, είναι η τιμή δικαιώματος (πριμ) της σύμβασης παραγώγων ανά υποκείμενο ή μονάδα του δείκτη. Στην περίπτωση τοποθετήσεων επί χρηματοπιστωτικών διαφορών (spread bets), είναι η τιμή αναφοράς του υποκείμενου μέσου. Στην περίπτωση συμβολαίων ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης (CDS), είναι το τοκομερίδιο σε μονάδες βάσης. Όταν η τιμή δηλώνεται με χρηματικούς όρους, αναφέρεται στη μονάδα του κύριου νομίσματος. Όταν η τιμή δεν είναι ακόμη διαθέσιμη, η αναγραφόμενη τιμή θα πρέπει να είναι «PNDG» (εκκρεμεί). Όταν δεν εφαρμόζεται τιμή, δεν συμπληρώνεται το πεδίο. Οι πληροφορίες που παρέχονται στο παρόν πεδίο είναι σύμφωνες με την τιμή που παρέχεται στο πεδίο «Ποσότητα».	RM, MTF, OTF APA CTP	{DECIMAL-18/13} σε περίπτωση που η τιμή εκφράζεται ως χρηματική αξία {DECIMAL-11/10} σε περίπτωση που η τιμή εκφράζεται ως ποσοστό ή απόδοση «PNDG» σε περίπτωση η τιμή που δεν είναι διαθέσιμη {DECIMAL-18/17} σε περίπτωση που η τιμή εκφράζεται ως μονάδες βάσης
Τόπος εκτέλεσης	Για όλα τα χρηματοπιστωτικά μέσα	Αναγνωριστικό στοιχείο του τόπου όπου εκτελέστηκε η συναλλαγή. Χρησιμοποιείται ο κωδικός MIC τμήματος, σύμφωνα με το πρότυπο ISO 10383, για συναλλαγές που εκτελούνται σε τόπο διαπραγμάτευσης. Εάν δεν υπάρχει κωδικός MIC τμήματος, χρησιμοποιείται ο κωδικός MIC λειτουργίας. Χρησιμοποιείται ο κωδικός MIC «XOFF» για χρηματοπιστωτικά μέσα εισηγμένα προς διαπραγμάτευση ή υπό διαπραγμάτευση σε τόπο διαπραγμάτευσης, όταν η συναλλαγή στο εν λόγω χρηματοπιστωτικό μέσο δεν εκτελείται σε τόπο διαπραγμάτευσης ή συστηματικό εσωτερικοποιητή ή οργανωμένο χώρο συναλλαγών εκτός της Ένωσης. Χρησιμοποιείται ο κωδικός «SINT» για χρηματοπιστωτικά μέσα εισηγμένα προς διαπραγμάτευση ή υπό διαπραγμάτευση σε τόπο διαπραγμάτευσης, όταν η συναλλαγή στο εν λόγω χρηματοπιστωτικό μέσο εκτελείται σε συστηματικό εσωτερικοποιητή.	RM, MTF, OTF APA CTP	{MIC} — τόποι διαπραγμάτευσης «SINT» — συστηματικός εσωτερικοποιητής

▼B

Λεπτομέρειες	Χρηματοπιστωτικά μέσα	Περιγραφή/Λεπτομέρειες που πρέπει να δημοσιεύονται	Είδος τόπου εκτέλεσης/ δημοσίευσης	Μορφότυπος που πρέπει να συμπληρώνεται όπως ορίζεται στον πίνακα 1
Ένδειξη συμβόλου τιμής	Για όλα τα χρηματοπιστωτικά μέσα	Δηλώνεται αν η τιμή εκφράζεται ως χρηματική αξία, ως ποσοστό ή ως απόδοση	RM, MTF, OTF APA CTP	«MONE» — Χρηματική αξία «PERC» — Ποσοστό «YIEL» — Απόδοση «BAPO» — Μονάδες βάσης
Νόμισμα τιμής	Για όλα τα χρηματοπιστωτικά μέσα	Το νόμισμα στο οποίο εκφράζεται η τιμή (εφαρμόζεται εάν η τιμή εκφράζεται ως χρηματική αξία)	RM, MTF, OTF APA CTP	{CURRENCYCODE_3}
Ένδειξη συμβόλου της ποσότητας στη μονάδα μέτρησης	Για παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων, παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής και δικαιώματα εκπομπής, εκτός από τις περιπτώσεις που περιγράφονται στο άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχεία α) και β) του παρόντος κανονισμού.	Ένδειξη των μονάδων μέτρησης στις οποίες εκφράζεται η ποσότητα στη μονάδα μέτρησης	RM, MTF, OTF APA CTP	«TOCD» — τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα Ή {ALPHANUM-25} άλλες περιπτώσεις
Ποσότητα στη μονάδα μέτρησης	Για παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων, παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής και δικαιώματα εκπομπής, εκτός από τις περιπτώσεις που περιγράφονται στο άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχεία α) και β) του παρόντος κανονισμού.	Η ισοδύναμη ποσότητα του βασικού εμπορεύματος ή του δικαιώματος εκπομπής που τελεί υπό διαπραγμάτευση, εκφρασμένη στη μονάδα μέτρησης	RM, MTF, OTF APA CTP	{DECIMAL-18/17}
Ποσότητα	Για όλα τα χρηματοπιστωτικά μέσα, εκτός από τις περιπτώσεις που περιγράφονται στο άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχεία α) και β) του παρόντος κανονισμού.	Ο αριθμός των μονάδων του χρηματοπιστωτικού μέσου ή ο αριθμός των συμβάσεων παραγώγων στη συναλλαγή.	RM, MTF, OTF APA CTP	{DECIMAL-18/17}
Ονομαστικό ποσό	Για όλα τα χρηματοπιστωτικά μέσα, εκτός από τις περιπτώσεις που περιγράφονται στο άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχεία α) και β) του παρόντος κανονισμού.	Θεωρητικό ποσό ή ονομαστικό ποσό Στην περίπτωση τοποθετήσεων επί χρηματοπιστωτικών διαφορών (spread bets), το ονομαστικό ποσό είναι η χρηματική αξία που στοιχηματίζεται ανά μοναδιαία διακύμανση του υποκείμενου χρηματοπιστωτικού μέσου.	RM, MTF, OTF APA CTP	{DECIMAL-18/5}

▼B

Λεπτομέρειες	Χρηματοπιστωτικά μέσα	Περιγραφή/Λεπτομέρειες που πρέπει να δημοσιεύονται	Είδος τόπου εκτέλεσης/ δημοσίευσης	Μορφότυπος που πρέπει να συμπληρώνεται όπως ορίζεται στον πίνακα 1
		Στην περίπτωση συμβολαίων ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης (CDS), είναι το ονομαστικό ποσό για το οποίο αγοράζεται ή πωλείται η προστασία. Οι πληροφορίες που παρέχονται στο παρόν πεδίο είναι σύμφωνες με την τιμή που παρέχεται στο πεδίο «Τιμή».		
Ονομαστικό νόμισμα	Για όλα τα χρηματοπιστωτικά μέσα, εκτός από τις περιπτώσεις που περιγράφονται στο άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχεία α) και β) του κανονισμού.	Νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το ονομαστικό ποσό	RM, MTF, OTF APA CTP	{CURRENCYCODE_3}
Είδος	Για δικαιώματα εκπομπής και παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής μόνον	Το πεδίο αυτό ισχύει μόνον για τα δικαιώματα εκπομπής και τα παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής.	RM, MTF, OTF APA CTP	«EUAE» — Γενικά δικαιώματα εκπομπής ΕΕ (EUA) «CERE» — Πιστοποιημένη μείωση των εκπομπών (CER) «ERUE» — Μονάδα μείωσης των εκπομπών (ERU) «EUAA» — Δικαιώματα εκπομπής ΕΕ του κλάδου των αερομεταφορών «OTHR» — Άλλα (μόνον για παράγωγα)
Ημερομηνία και ώρα δημοσίευσης	Για όλα τα χρηματοπιστωτικά μέσα	Ημερομηνία και ώρα κατά την οποία δημοσιεύθηκε η συναλλαγή από τόπο διαπραγμάτευσης ή ΕΜΔ. Για συναλλαγές που εκτελούνται σε τόπο διαπραγμάτευσης, το επίπεδο λεπτομέρειας προσδιορίζεται σύμφωνα με τις απαιτήσεις που καθορίζονται στο άρθρο 2 του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/574. Για συναλλαγές που δεν εκτελούνται σε τόπο διαπραγμάτευσης, η ώρα αναφέρεται με ακρίβεια προσέγγισης τουλάχιστον δευτερολέπτου.	RM, MTF, OTF APA CTP	{DATE_TIME_FORMAT}
Τόπος δημοσίευσης	Για όλα τα χρηματοπιστωτικά μέσα	Κωδικός που χρησιμοποιείται για την ταυτοποίηση του τόπου διαπραγμάτευσης και του ΕΜΔ που δημοσιεύει τη συναλλαγή.	CTP	Τόπος διαπραγμάτευσης: {MIC}

▼B

Λεπτομέρειες	Χρηματοπιστωτικά μέσα	Περιγραφή/Λεπτομέρειες που πρέπει να δημοσιεύονται	Είδος τόπου εκτέλεσης/ δημοσίευσης	Μορφότυπος που πρέπει να συμπληρώνεται όπως ορίζεται στον πίνακα 1
				APA: {MIC}, όπου υπάρχει. Ειδάλλως, κωδικός με 4 χαρακτήρες, όπως δημοσιεύεται στον κατάλογο παρόχων υπηρεσιών αναφοράς δεδομένων στον δικτυακό τόπο της ΕΑΚΑΑ.
Αναγνωριστικός κωδικός συναλλαγής	Για όλα τα χρηματοπιστωτικά μέσα	Αλφαριθμητικός κωδικός που αποδίδεται από τόπους διαπραγμάτευσης [σύμφωνα με το άρθρο 12 του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/580 ([2])] και ΕΜΔ, και χρησιμοποιείται σε κάθε μεταγενέστερη αναφορά στη συγκεκριμένη συναλλαγή. Ο αναγνωριστικός κωδικός συναλλαγής είναι μοναδικός, ομοιόμορφος και σταθερός ανά κωδικό MIC τμήματος, σύμφωνα με το πρότυπο ISO 10383, και ανά ημέρα διαπραγμάτευσης. Εάν ο τόπος διαπραγμάτευσης δεν χρησιμοποιεί κωδικούς MIC τμήματος, ο αναγνωριστικός κωδικός συναλλαγής είναι μοναδικός, ομοιόμορφος και σταθερός ανά κωδικό MIC λειτουργίας ανά ημέρα διαπραγμάτευσης. Εάν ο ΕΜΔ δεν χρησιμοποιεί κωδικούς MIC, ο κωδικός θα πρέπει να είναι μοναδικός, ομοιόμορφος και σταθερός ανά κωδικό με 4 χαρακτήρες χρησιμοποιούμενο για την ταυτοποίηση του ΕΜΔ ανά ημέρα διαπραγμάτευσης. Τα συστατικά στοιχεία του αναγνωριστικού κωδικού συναλλαγής δεν αποκαλύπτουν την ταυτότητα των αντισυμβαλλομένων της συναλλαγής στην οποία αποδίδεται ο κωδικός.	RM, MTF, OTF APA CTP	{ALPHANUMERICAL-52}
Συναλλαγή προς εκκαθάριση	Για παράγωγα	Κωδικός που προσδιορίζει αν θα εκκαθαριστεί η συναλλαγή.	RM, MTF, OTF APA CTP	«true» — συναλλαγή προς εκκαθάριση «false» — συναλλαγή όχι προς εκκαθάριση

([1]) Κατ' εξουσιοδότηση κανονισμός (ΕΕ) 2017/574 της Επιτροπής, της 7ης Ιουνίου 2016, για τη συμπλήρωση της οδηγίας 2014/65/ΕΕ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου όσον αφορά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα για το επίπεδο ακριβείας των ρολογιών εργασίας (βλέπε σελίδα 148 της παρούσας Επίσημης Εφημερίδας).

([2]) Κατ' εξουσιοδότηση κανονισμός (ΕΕ) 2017/580 της Επιτροπής, της 24ης Ιουνίου 2016, για τη συμπλήρωση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου όσον αφορά ρυθμιστικά τεχνικά πρότυπα για την τήρηση σχετικών στοιχείων που αφορούν εντολές για χρηματοπιστωτικά μέσα (βλέπε σελίδα 193 της παρούσας Επίσημης Εφημερίδας).

▼B

Πίνακας 3

Κατάλογος σημάνσεων για τους σκοπούς μετασυναλλακτικής διαφάνειας

	Σήμανση	Ονομασία της σήμανσης	Είδος τόπου εκτέλεσης/ δημοσίευσης	Περιγραφή
	«BENC»	Σήμανση συναλλαγής με βάση δείκτη αναφοράς	RM, MTF, OTF APA CTP	Όλα τα είδη των συναλλαγών στη μέση σταθμισμένη βάσει όγκου τιμή και όλες οι άλλες συναλλαγές όπου η τιμή υπολογίζεται σε περισσότερες της μιας χρονικές στιγμές σύμφωνα με δεδομένο δείκτη αναφοράς.
	«ACTX»	Σήμανση συναλλαγής διασταύρωσης (agency cross)	APA CTP	Συναλλαγές όπου μια επιχείρηση επενδύσεων έχει συγκεντρώσει εντολές δύο πελατών κατά τρόπο ώστε η αγορά και η πώληση να διενεργούνται ως μία συναλλαγή που αφορά τον ίδιο όγκο και την ίδια τιμή.
	«NPFT»	Σήμανση συναλλαγής χωρίς διαμόρφωση τιμών	RM, MTF, OTF CTP	Όλα τα είδη συναλλαγών που αναφέρονται στο άρθρο 12 του παρόντος κανονισμού και δεν συμβάλλουν στη διαμόρφωση των τιμών.
	«LRGS»	Σήμανση συναλλαγής μετασυναλλακτικού μεγάλου μεγέθους (LIS)	RM, MTF, OTF APA CTP	Συναλλαγές που εκτελούνται στο πλαίσιο της μετασυναλλακτικής χρονικής μετάθεσης λόγω μεγάλου μεγέθους.
	«ILQD»	Σήμανση συναλλαγής μη ευχερώς ρευστοποιήσιμου μέσου	RM, MTF, OTF APA CTP	Συναλλαγές που εκτελούνται στο πλαίσιο της χρονικής μετάθεσης για μέσα για τα οποία δεν υπάρχει ρευστή αγορά.
	«SIZE»	Σήμανση συναλλαγής μετασυναλλακτικού SSTI	RM, MTF, OTF APA CTP	Συναλλαγές που εκτελούνται στο πλαίσιο της μετασυναλλακτικής χρονικής μετάθεσης λόγω ειδικού μεγέθους του μέσου (size specific to instrument).
	«TPAC»	Σήμανση συναλλαγής πακέτου	RM, MTF, OTF APA CTP	Συναλλαγές πακέτου που δεν είναι ανταλλαγή με φυσική παράδοση, όπως ορίζεται στο άρθρο 1.
	«XFPH»	Σήμανση συναλλαγής με ανταλλαγή με φυσική παράδοση	RM, MTF, OTF APA CTP	Ανταλλαγή με φυσική παράδοση, όπως ορίζεται στο άρθρο 1.
	«CANC»	Σήμανση ακύρωσης	RM, MTF, OTF APA CTP	Σε περίπτωση ακύρωσης μιας συναλλαγής που έχει προηγουμένως δημοσιευθεί.

▼B

	Σήμανση	Ονομασία της σήμανσης	Είδος τόπου εκτέλεσης/ δημοσίευσης	Περιγραφή
	«AMND»	Σήμανση τροποποίησης	RM, MTF, OTF APA CTP	Σε περίπτωση τροποποίησης μιας συναλλαγής που έχει προηγουμένως δημοσιευθεί.

ΣΥΜΠΛΗΡΩΜΑΤΙΚΕΣ ΣΗΜΑΝΣΕΙΣ ΧΡΟΝΙΚΗΣ ΜΕΤΑΘΕΣΗΣ

Άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχείο α) σημείο i)	«LMTF»	Σήμανση περιορισμένων στοιχείων	RM, MTF, OTF APA CTP	Πρώτη αναφορά με τη δημοσίευση περιορισμένων στοιχείων, σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχείο α) σημείο i).
	«FULF»	Σήμανση πλήρων στοιχείων		Συναλλαγή για την οποία έχουν ήδη δημοσιευθεί περιορισμένα στοιχεία, σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχείο α) σημείο i).
Άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχείο α) σημείο ii)	«DATF»	Σήμανση ημερήσιων συγκεντρωτικών συναλλαγών	RM, MTF, OTF APA CTP	Δημοσίευση ημερήσιων συγκεντρωτικών συναλλαγών, σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχείο α) σημείο ii).
	«FULA»	Σήμανση πλήρων στοιχείων	RM, MTF, OTF APA CTP	Μεμονωμένες συναλλαγές για τις οποίες έχουν ήδη δημοσιευθεί συγκεντρωτικά στοιχεία, σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχείο α) σημείο ii).
Άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχείο β)	«VOLO»	Σήμανση παράλειψης όγκου	RM, MTF, OTF APA CTP	Συναλλαγή για την οποία δημοσιεύονται περιορισμένα στοιχεία, σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχείο β).
	«FULV»	Σήμανση πλήρων στοιχείων	RM, MTF, OTF APA CTP	Συναλλαγή για την οποία έχουν ήδη δημοσιευθεί περιορισμένα στοιχεία, σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχείο β).
Άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχείο γ)	«FWAF»	Σήμανση συγκεντρωτικών συναλλαγών τεσσάρων εβδομάδων	RM, MTF, OTF APA CTP	Δημοσίευση συγκεντρωτικών συναλλαγών, σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχείο γ).
	«FULJ»	Σήμανση πλήρων στοιχείων	RM, MTF, OTF APA CTP	Μεμονωμένες συναλλαγές οι οποίες έχουν ήδη τύχει συγκεντρωτικής δημοσίευσης, σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχείο γ).
Άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχείο δ)	«IDAF»	Σήμανση συγκεντρωτικών συναλλαγών για αόριστο χρονικό διάστημα	RM, MTF, OTF APA CTP	Συναλλαγές για τις οποίες επιτρέπεται η δημοσίευση διαφόρων συναλλαγών σε συγκεντρωτική μορφή για αόριστο χρονικό διάστημα, σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχείο δ).

▼B

	Σήμανση	Ονομασία της σήμανσης	Είδος τόπου εκτέλεσης/ δημοσίευσης	Περιγραφή
Διαδοχική χρήση του άρθρου 11 παράγραφος 1 στοιχείο β) και του άρθρου 11 παράγραφος 2 στοιχείο γ) για κρατικούς χρεωστικούς τίτλους	«VOLW»	Σήμανση παράλειψης όγκου	RM, MTF, OTF APA CTP	Συναλλαγή για την οποία δημοσιεύονται περιορισμένα στοιχεία, σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχείο β), και για την οποία θα επιτρέπεται διαδοχικά η δημοσίευση διαφόρων συναλλαγών σε συγκεντρωτική μορφή για αόριστο χρονικό διάστημα, σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 2 στοιχείο γ).
	«COAF»	Σήμανση διαδοχικών συγκεντρωτικών συναλλαγών (μετά την παράλειψη του όγκου για κρατικούς χρεωστικούς τίτλους)	RM, MTF, OTF APA CTP	Συναλλαγή για την οποία έχουν ήδη δημοσιευθεί περιορισμένα στοιχεία, σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 1 στοιχείο β), και για την οποία έχει επιτραπεί διαδοχικά η δημοσίευση διαφόρων συναλλαγών σε συγκεντρωτική μορφή για αόριστο χρονικό διάστημα, σύμφωνα με το άρθρο 11 παράγραφος 2 στοιχείο γ).

Πίνακας 4

Μονάδα μέτρησης όγκου

Είδος μέσου	Όγκος
Όλες οι ομολογίες πλην των ETC και των ETN και των δομημένων χρηματοπιστωτικών προϊόντων	Συνολική ονομαστική αξία των χρεωστικών τίτλων που τελούν υπό διαπραγμάτευση
Είδη ομολογιών ETC και ETN	Αριθμός μονάδων υπό διαπραγμάτευση ([1])
Τιτλοποιημένα παράγωγα	Αριθμός μονάδων υπό διαπραγμάτευση ([1])
Παράγωγα επί επιτοκίων	Ονομαστικό ποσό συμβάσεων υπό διαπραγμάτευση
Παράγωγα επί συναλλάγματος	Ονομαστικό ποσό συμβάσεων υπό διαπραγμάτευση
Παράγωγα επί μετοχών	Ονομαστικό ποσό συμβάσεων υπό διαπραγμάτευση
Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων·	Ονομαστικό ποσό συμβάσεων υπό διαπραγμάτευση
Πιστωτικά παράγωγα	Ονομαστικό ποσό συμβάσεων υπό διαπραγμάτευση
Συμβάσεις επί διαφοράς	Ονομαστικό ποσό συμβάσεων υπό διαπραγμάτευση
Παράγωγα C10	Ονομαστικό ποσό συμβάσεων υπό διαπραγμάτευση
Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής	Τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα
Δικαιώματα εκπομπής	Τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα

([1]) Τιμή ανά μονάδα.

▼B

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ III

Αξιολόγηση ρευστότητας, όρια LIS και SSTI για μη μετοχικά χρηματοπιστωτικά μέσα

1. **Οδηγίες για τους σκοπούς του παρόντος παραρτήματος**

1. Ως «κατηγορία στοιχείων ενεργητικού» νοούνται οι ακόλουθες κατηγορίες χρηματοπιστωτικών μέσων: ομολογίες, δομημένα χρηματοπιστωτικά προϊόντα, τιτλοποιημένα παράγωγα, παράγωγα επί επιτοκίων, παράγωγα επί μετοχών, παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων, παράγωγα επί συναλλάγματος, πιστωτικά παράγωγα, παράγωγα C10, συμβάσεις επί διαφοράς (CFD), δικαιώματα εκπομπής και παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής.

2. Ως «κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού» νοείται μια κατηγορία στοιχείων ενεργητικού που έχει κατατμηθεί σε λεπτομερέστερο επίπεδο, με βάση το είδος της σύμβασης ή/και το είδος του υποκείμενου στοιχείου.

3. Ως «υποκατηγορία» νοείται μια κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού που έχει κατατμηθεί σε λεπτομερέστερο επίπεδο, με βάση περαιτέρω ποιοτικά κριτήρια κατάτμησης, όπως ορίζεται στους πίνακες 2.1 έως 13.3 του παρόντος παραρτήματος.

4. Ως «μέση ημερήσια αξία συναλλαγών (ΜΗΑΣ)» νοείται η συνολική αξία συναλλαγών για ένα συγκεκριμένο χρηματοπιστωτικό μέσο, που καθορίζεται σύμφωνα με το μέτρο όγκου που ορίζεται στον πίνακα 4 του παραρτήματος II και εκτελέστηκε κατά την περίοδο που ορίζεται στο άρθρο 13 παράγραφος 7, διαιρούμενη με τον αριθμό των ημερών διαπραγμάτευσης σε αυτή την περίοδο ή, κατά περίπτωση, την περίοδο του έτους κατά την οποία το χρηματοπιστωτικό μέσο ήταν εισηγμένο προς διαπραγμάτευση ή τελούσε υπό διαπραγμάτευση σε τόπο διαπραγμάτευσης και η διαπραγμάτευσή του δεν είχε ανασταλεί.

5. Ως «μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA)» νοείται το συνολικό ονομαστικό ποσό για ένα συγκεκριμένο χρηματοπιστωτικό μέσο, που καθορίζεται σύμφωνα με το μέτρο όγκου που ορίζεται στον πίνακα 4 του παραρτήματος II και εκτελέστηκε κατά την περίοδο που ορίζεται στο άρθρο 13 παράγραφος 18 για όλες τις ομολογίες πλην των ETC και ETN και στο άρθρο 13 παράγραφος 7 για όλα τα άλλα χρηματοπιστωτικά μέσα, διαιρούμενο με τον αριθμό των ημερών διαπραγμάτευσης σε αυτή την περίοδο ή, κατά περίπτωση, την περίοδο του έτους κατά την οποία το χρηματοπιστωτικό μέσο ήταν εισηγμένο προς διαπραγμάτευση ή τελούσε υπό διαπραγμάτευση σε τόπο διαπραγμάτευσης και η διαπραγμάτευσή του δεν είχε ανασταλεί.

6. Ως «ποσοστό των ημερών διαπραγμάτευσης κατά την εξεταζόμενη περίοδο» νοείται ο αριθμός των ημερών της περιόδου που ορίζεται στο άρθρο 13 παράγραφος 18 για όλες τις ομολογίες πλην των ETC και ETN και στο άρθρο 13 παράγραφος 7 για τα δομημένα χρηματοπιστωτικά προϊόντα, για τα οποία έχει εκτελεστεί τουλάχιστον μία συναλλαγή για το συγκεκριμένο χρηματοπιστωτικό μέσο, διαιρούμενος με τον αριθμό των ημερών διαπραγμάτευσης σε αυτή την περίοδο ή, κατά περίπτωση, την περίοδο του έτους κατά την οποία το χρηματοπιστωτικό μέσο ήταν εισηγμένο προς διαπραγμάτευση ή τελούσε υπό διαπραγμάτευση σε τόπο διαπραγμάτευσης και η διαπραγμάτευσή του δεν είχε ανασταλεί.

7. Ως «μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών» νοείται ο συνολικός αριθμός συναλλαγών που εκτελέστηκαν για ένα συγκεκριμένο χρηματοπιστωτικό μέσο κατά την περίοδο που ορίζεται στο άρθρο 13 παράγραφος 18 για όλες τις ομολογίες πλην των ETC και ETN και στο άρθρο 13 παράγραφος 7 για όλα τα άλλα χρηματοπιστωτικά μέσα, διαιρούμενος με τον αριθμό των ημερών διαπραγμάτευσης σε αυτή την περίοδο ή, κατά περίπτωση, την περίοδο του έτους κατά την οποία το χρηματοπιστωτικό μέσο ήταν εισηγμένο προς διαπραγμάτευση ή τελούσε υπό διαπραγμάτευση σε τόπο διαπραγμάτευσης και η διαπραγμάτευσή του δεν είχε ανασταλεί.

▼B

8. Ως «συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης (future)» νοείται η σύμβαση αγοράς ή πώλησης βασικού εμπορεύματος ή χρηματοπιστωτικού μέσου σε καθορισμένη μελλοντική ημερομηνία σε τιμή που συμφωνήθηκε κατά τη σύναψη της σύμβασης από τον αγοραστή και τον πωλητή. Κάθε συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης έχει τυπικούς όρους που υπαγορεύουν την ελάχιστη ποσότητα και την ποιότητα που μπορούν να αγοραστούν ή να πωληθούν, το μικρότερο ποσό κατά το οποίο μπορεί να αλλάξει η τιμή, τις διαδικασίες παράδοσης, την ημερομηνία ληκτότητας και άλλα χαρακτηριστικά που σχετίζονται με τη σύμβαση.

9. Ως «δικαίωμα προαίρεσης (option)» νοείται μια σύμβαση που παρέχει στον κάτοχο το δικαίωμα, αλλά όχι την υποχρέωση, να αγοράσει (call) ή να πωλήσει (put) ένα συγκεκριμένο χρηματοπιστωτικό μέσο ή βασικό εμπόρευμα σε προκαθορισμένη τιμή, τιμή άσκησης, σε ή έως μια ορισμένη μελλοντική ημερομηνία ή ημερομηνία άσκησης.

10. Ως «συμφωνία ανταλλαγής (swap)» νοείται μια σύμβαση με την οποία δύο μέρη συμφωνούν να ανταλλάξουν ταμειακές ροές σε ένα χρηματοπιστωτικό μέσο με ταμειακές ροές ενός άλλου χρηματοπιστωτικού μέσου σε μια ορισμένη μελλοντική ημερομηνία.

11. Ως «συμφωνία ανταλλαγής χαρτοφυλακίου» νοείται μια σύμβαση με την οποία οι τελικοί χρήστες μπορούν να ανταλλάξουν περισσότερες από μία συμφωνίες ανταλλαγής.

12. Ως «προθεσμιακή σύμβαση (forward/forward agreement)» νοείται ιδιωτικό συμφωνητικό μεταξύ δύο μερών για την αγορά ή πώληση βασικού εμπορεύματος ή χρηματοπιστωτικού μέσου σε καθορισμένη μελλοντική ημερομηνία σε τιμή που συμφωνήθηκε κατά τη σύναψη της σύμβασης από τον αγοραστή και τον πωλητή.

13. Ως «δικαίωμα προαίρεσης επί συμφωνιών ανταλλαγής (swaption)» νοείται μια σύμβαση που παρέχει στον κάτοχο το δικαίωμα, αλλά όχι την υποχρέωση, να συνάψει μια συμφωνία ανταλλαγής σε ή έως μια ορισμένη μελλοντική ημερομηνία ή ημερομηνία άσκησης.

14. Ως «συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης σε συμφωνία ανταλλαγής» νοείται ένα συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης που παρέχει στον κάτοχο την υποχρέωση να συνάψει μια συμφωνία ανταλλαγής σε ή έως μια ορισμένη μελλοντική ημερομηνία.

15. Ως «προθεσμιακή σύμβαση σε συμφωνία ανταλλαγής» νοείται μια προθεσμιακή σύμβαση που παρέχει στον κάτοχο την υποχρέωση να συνάψει μια συμφωνία ανταλλαγής σε ή έως μια ορισμένη μελλοντική ημερομηνία.

2. **Ομολογίες**

Πίνακας 2.1

Ομολογίες (όλα τα είδη ομολογιών πλην των ETC και ETN) — κατηγορίες χωρίς ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Ομολογίες (όλα τα είδη ομολογιών πλην των ETC και ETN)					
Για κάθε επιμέρους χρηματοπιστωτικό μέσο καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας σε σωρευτική βάση					
Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]				**Ποσοστό ημερών διαπραγμάτευσης κατά την εξεταζόμενη περίοδο** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 3]
100 000 ευρώ	S1	S2	S3	S4	80 %
	15	10	7	2	

▼B

Πίνακας 2.2

Ομολογίες (όλα τα είδη ομολογιών πλην των ETC και ETN) — κατηγορίες χωρίς ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Ομολογίες (όλα τα είδη ομολογιών πλην των ETC και ETN)

Για κάθε επιμέρους ομολογία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 13 παράγραφος 18, εάν χαρακτηρίζεται από συγκεκριμένο συνδυασμό είδους ομολογίας και μεγέθους έκδοσης, όπως ορίζεται σε κάθε γραμμή του πίνακα.

Είδος ομολογίας		**Μέγεθος έκδοσης**			
Κρατική ομολογία	ομολογία που εκδίδεται από έναν κρατικό εκδότη ο οποίος είναι: α) η Ένωση· β) κράτος μέλος, συμπεριλαμβανομένου οποιουδήποτε κυβερνητικού φορέα ή οργανισμού ή φορέα ειδικού σκοπού του κράτους μέλους· γ) κρατικός φορέας που δεν περιλαμβάνεται στα στοιχεία α) και β).	μικρότερο από (σε ευρώ)		1 000 000 000	
Άλλες ομολογίες του Δημοσίου	ομολογία που εκδίδεται από οποιονδήποτε από τους ακόλουθους εκδότες του Δημοσίου: α) σε περίπτωση ομοσπονδιακού κράτους μέλους, ένα από τα μέλη που συγκροτούν την ομοσπονδία· β) φορέα ειδικού σκοπού για διάφορα κράτη μέλη· γ) διεθνές χρηματοπιστωτικό ίδρυμα που έχει συσταθεί από δύο ή περισσότερα κράτη μέλη, σκοπός του οποίου είναι η κινητοποίηση χρηματοδότησης και η παροχή χρηματοοικονομικής βοήθειας προς όφελος των μελών του, τα οποία αντιμετωπίζουν ή απειλούνται με σοβαρά προβλήματα χρηματοδότησης· δ) την Ευρωπαϊκή Τράπεζα Επενδύσεων· ε) οντότητα του Δημοσίου που δεν είναι εκδότης κρατικής ομολογίας, όπως ορίζεται στην προηγούμενη γραμμή.	μικρότερο από (σε ευρώ)		500 000 000	
Μετατρέψιμη ομολογία	μέσο που αποτελείται από ομολογία ή τιτλοποιημένο χρεωστικό τίτλο με ενσωματωμένο παράγωγο, όπως δικαίωμα προαίρεσης για την αγορά της υποκείμενης μετοχής	μικρότερο από (σε ευρώ)		500 000 000	
Καλυμμένη ομολογία	οι ομολογίες που αναφέρονται στο άρθρο 52 παράγραφος 4 της οδηγίας 2009/65/ΕΚ	κατά τα στάδια S1 και S2		κατά τα στάδια S3 και S4	
		μικρότερο από (σε ευρώ)	1 000 000 000	μικρότερο από (σε ευρώ)	500 000 000

▼B

Είδος ομολογίας		Μέγεθος έκδοσης			
Εταιρική ομολογία	ομολογία που εκδίδεται από ευρωπαϊκή ανώνυμη εταιρεία που έχει ιδρυθεί σύμφωνα με τον κανονισμό (ΕΚ) αριθ. 2157/2001 του Συμβουλίου ([1]), ή τύπο εταιρείας που αναφέρεται στο άρθρο 1 της οδηγίας 2009/101/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου ([2]) ή ισοδύναμο σε τρίτες χώρες	κατά τα στάδια S1 και S2		κατά τα στάδια S3 και S4	
		μικρότερο από (σε ευρώ)	1 000 000 000	μικρότερο από (σε ευρώ)	500 000 000
Είδος ομολογίας	**Για τον προσδιορισμό των χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 13 παράγραφος 18, εφαρμόζεται η ακόλουθη μεθοδολογία**				
Άλλη ομολογία	Για τις ομολογίες που δεν ανήκουν σε κανένα από τα ανωτέρω είδη ομολογιών θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά				

([1]) Κανονισμός (ΕΚ) αριθ. 2157/2001 του Συμβουλίου της 8ης Οκτωβρίου 2001 περί του καταστατικού της ευρωπαϊκής εταιρίας (SE) (ΕΕ L 294 της 10.11.2001, σ. 1).

([2]) Οδηγία 2009/101/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου της 16ης Σεπτεμβρίου 2009 περί συντονισμού των εγγυήσεων που απαιτούνται στα κράτη μέλη εκ μέρους των εταιρειών, κατά την έννοια του άρθρου 48 δεύτερο εδάφιο της συνθήκης, για την προστασία των συμφερόντων των εταίρων και των τρίτων, με σκοπό να καταστούν οι εγγυήσεις αυτές ισοδύναμες (ΕΕ L 258 της 1.10.2009, σ. 11).

▼B

Πίνακας 2.3

Ομολογίες (όλα τα είδη ομολογιών πλην των ETC και ETN) — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Ομολογίες (όλα τα είδη ομολογιών πλην των ETC και ETN)											
Είδος ομολογίας	**Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τον υπολογισμό των ορίων ανά είδος ομολογίας**	**Εκατοστημόρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για κάθε είδος ομολογίας**										
		Προσυναλλακτικό SSTI					**Προσυναλλακτικό LIS**			**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**		**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**
Κρατική ομολογία	συναλλαγές που εκτελούνται σε κρατικές ομολογίες, μετά την εξαίρεση των συναλλαγών που ορίζονται στο άρθρο 13 παράγραφος 10	S1	S2	S3	S4	300 000 ευρώ	70	300 000 ευρώ		80	90
		30	40	50	60						
Άλλες ομολογίες του Δημοσίου	συναλλαγές που εκτελούνται σε άλλες ομολογίες του Δημοσίου, μετά την εξαίρεση των συναλλαγών που ορίζονται στο άρθρο 13 παράγραφος 10	S1	S2	S3	S4	300 000 ευρώ	70	300 000 ευρώ		80	90
		30	40	50	60						
Μετατρέψιμη ομολογία	συναλλαγές που εκτελούνται σε μετατρέψιμες ομολογίες, μετά την εξαίρεση των συναλλαγών που ορίζονται στο άρθρο 13 παράγραφος 10	S1	S2	S3	S4	200 000 ευρώ	70	200 000 ευρώ		80	90
		30	40	50	60						
Καλυμμένη ομολογία	συναλλαγές που εκτελούνται σε καλυμμένες ομολογίες, μετά την εξαίρεση των συναλλαγών που ορίζονται στο άρθρο 13 παράγραφος 10	S1	S2	S3	S4	300 000 ευρώ	70	300 000 ευρώ		80	90
		30	40	40	40						
Εταιρική ομολογία	συναλλαγές που εκτελούνται σε εταιρικές ομολογίες, μετά την εξαίρεση των συναλλαγών που ορίζονται στο άρθρο 13 παράγραφος 10	S1	S2	S3	S4	200 000 ευρώ	70	200 000 ευρώ		80	90
		30	40	50	60						
Άλλες ομολογίες	συναλλαγές που εκτελούνται σε άλλες ομολογίες, μετά την εξαίρεση των συναλλαγών που ορίζονται στο άρθρο 13 παράγραφος 10	S1	S2	S3	S4	200 000 ευρώ	70	200 000 ευρώ		80	90
		30	40	50	60						

Πίνακας 2.4

Ομολογίες (είδη ομολογιών ETC και ETN) — κατηγορίες χωρίς ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Ομολογίες (είδη ομολογιών ETC και ETN)		
Είδος ομολογίας	**Για κάθε επιμέρους χρηματοπιστωτικό μέσο καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας**	
	Μέση ημερήσια αξία συναλλαγών (ΜΗΑΣ) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
Βασικά εμπορεύματα εισηγμένα στο χρηματιστήριο (EDC) χρεωστικός τίτλος που εκδίδεται για μια άμεση επένδυση από τον εκδότη σε βασικά εμπορεύματα ή συμβάσεις παραγώγων επί βασικών εμπορευμάτων. Η τιμή του ETC είναι άμεσα ή έμμεσα συνδεδεμένη με την απόδοση του υποκείμενου στοιχείου. Ένα ETC παρακολουθεί παθητικά την απόδοση του βασικού εμπορεύματος ή των δεικτών βασικών εμπορευμάτων στους οποίους αναφέρεται.	500 000 ευρώ	10
Διαπραγματεύσιμες ομολογίες (ETN) χρεωστικός τίτλος που εκδίδεται για μια άμεση επένδυση από τον εκδότη στο υποκείμενο στοιχείο ή τις υποκείμενες συμβάσεις παραγώγων. Η τιμή του ETN είναι άμεσα ή έμμεσα συνδεδεμένη με την απόδοση του υποκείμενου στοιχείου. Ένα ETN παρακολουθεί παθητικά την απόδοση του υποκείμενου στοιχείου στο οποίο αναφέρεται.	500 000 ευρώ	10

Πίνακας 2.5

Ομολογίες (είδη ομολογιών ETC και ETN) — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Ομολογίες (είδη ομολογιών ETC και ETN)				
Προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για κάθε χρηματοπιστωτικό μέσο για το οποίο καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά				
Είδος ομολογίας	**Προσυναλλακτικό SSTI**	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
	Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
ETC	1 000 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ	50 000 000 ευρώ	50 000 000 ευρώ
ETN	1 000 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ	50 000 000 ευρώ	50 000 000 ευρώ

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Ομολογίες (είδη ομολογιών ETC και ETN)				
Προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για κάθε χρηματοπιστωτικό μέσο για το οποίο καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά				
Είδος ομολογίας	**Προσυναλλακτικό SSTI**	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
	Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
ETC	900 000 ευρώ	900 000 ευρώ	45 000 000 ευρώ	45 000 000 ευρώ
ETN	900 000 ευρώ	900 000 ευρώ	45 000 000 ευρώ	45 000 000 ευρώ

3. **Δομημένα χρηματοπιστωτικά προϊόντα (SFP)**

Πίνακας 3.1

SFP — κατηγορίες για τις οποίες δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Δομημένα χρηματοπιστωτικά προϊόντα (SFP)		
Δοκιμή 1 — αξιολόγηση κατηγορίας στοιχείων ενεργητικού SFP		
Αξιολόγηση κατηγορίας στοιχείων ενεργητικού SFP για τον προσδιορισμό των χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β)		
Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των τιμών που σχετίζονται με τα ποσοτικά κριτήρια ρευστότητας για τους σκοπούς της αξιολόγησης της κατηγορίας στοιχείων ενεργητικού SFP	**Η κατηγορία στοιχείων ενεργητικού SFP αξιολογείται με εφαρμογή των ακόλουθων ορίων των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας**	
	Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
Συναλλαγές που εκτελούνται σε όλα τα SFP	300 000 000 ευρώ	500
Δοκιμή 2 — SFP για τα οποία δεν υπάρχει ρευστή αγορά		
Εάν οι τιμές που σχετίζονται με τα ποσοτικά κριτήρια ρευστότητας είναι και οι δύο πάνω από τα ποσοτικά όρια ρευστότητας που καθορίζονται για τους σκοπούς της αξιολόγησης της κατηγορίας στοιχείων ενεργητικού SFP, η δοκιμή 1 είναι θετική και εκτελείται η δοκιμή 2. Για κάθε επιμέρους χρηματοπιστωτικό μέσο καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας		
Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]	**Ποσοστό ημερών διαπραγμάτευσης κατά την εξεταζόμενη περίοδο** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 3]
100 000 ευρώ	2	80 %

▼B

Πίνακας 3.2

SFP — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS, εάν η δοκιμή 1 δεν είναι επιτυχής

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Δομημένα χρηματοπιστωτικά προϊόντα (SFP)			
Προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS, εάν η δοκιμή 1 δεν είναι επιτυχής			
Προσυναλλακτικό SSTI	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
100 000 ευρώ	250 000 ευρώ	500 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ

Πίνακας 3.3

SFP — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS, εάν η δοκιμή 1 είναι επιτυχής

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Δομημένα χρηματοπιστωτικά προϊόντα (SFP)												
Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τον υπολογισμό των ορίων	**Εκατοστημόρια και κατώτατες τιμές που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για τα SFP για τα οποία καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εάν η δοκιμή 1 είναι επιτυχής**											
	Προσυναλλακτικό SSTI					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**		**Μετασυναλλακτικό LIS**		
	Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	
Συναλλαγές που εκτελούνται σε όλα τα SFP για τα οποία καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά	S1	S2	S3	S4	100 000 ευρώ	70	250 000 ευρώ	80	500 000 ευρώ	90	1 000 000 ευρώ	
	30	40	50	60								

Προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για SFP για τα οποία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, εάν η δοκιμή 1 είναι επιτυχής			
Προσυναλλακτικό SSTI	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
100 000 ευρώ	250 000 ευρώ	500 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ

▼B

4. **Τιτλοποιημένα παράγωγα**

Πίνακας 4.1

Τιτλοποιημένα παράγωγα — κατηγορίες για τις οποίες δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείου ενεργητικού — Τιτλοποιημένα παράγωγα
μια κινητή αξία, όπως ορίζεται στο άρθρο 4 παράγραφος 1 σημείο 44) στοιχείο γ) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ που είναι διαφορετική από τα δομημένα χρηματοπιστωτικά προϊόντα και θα πρέπει να περιλαμβάνει τουλάχιστον:
α) ως απλοί («plain vanilla») καλυμμένοι τίτλοι επιλογής νοούνται τίτλοι που παρέχουν στον κάτοχο το δικαίωμα, αλλά όχι την υποχρέωση, να αγοράσει (να πωλήσει), κατά την ημερομηνία λήξης ή έως αυτήν, ένα συγκεκριμένο ποσό του υποκείμενου στοιχείου ενεργητικού σε προκαθορισμένη τιμή άσκησης ή, σε περίπτωση που επιτευχθεί ένας τέτοιος χρηματικός διακανονισμός, η καταβολή της θετικής διαφοράς μεταξύ της τρέχουσας τιμής της αγοράς (τιμή άσκησης) και της τιμής άσκησης (τρέχουσα τιμή αγοράς)·
β) ως πιστοποιητικά μόχλευσης νοούνται πιστοποιητικά που παρακολουθούν την απόδοση του υποκείμενου στοιχείου ενεργητικού με αποτέλεσμα μόχλευσης·
γ) ως εξωτικοί καλυμμένοι τίτλοι επιλογής νοούνται καλυμμένοι τίτλοι επιλογής των οποίων το κύριο στοιχείο είναι συνδυασμός δικαιωμάτων προαίρεσης·
δ) διαπραγματεύσιμα δικαιώματα·
ε) ως πιστοποιητικά επενδύσεων νοούνται πιστοποιητικά που παρακολουθούν την απόδοση του υποκείμενου στοιχείου ενεργητικού χωρίς αποτέλεσμα μόχλευσης.
Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εφαρμόζεται η ακόλουθη μεθοδολογία
για όλα τα τιτλοποιημένα παράγωγα θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά

Πίνακας 4.2

Τιτλοποιημένα παράγωγα — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS

Κατηγορία στοιχείου ενεργητικού — Τιτλοποιημένα παράγωγα			
Προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS			
Προσυναλλακτικό SSTI	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
50 000 ευρώ	60 000 ευρώ	90 000 ευρώ	100 000 ευρώ

▼B

5. **Παράγωγα επί επιτοκίων**

Πίνακας 5.1

Παράγωγα επί επιτοκίων — κατηγορίες για τις οποίες δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί επιτοκίων				
κάθε σύμβαση, όπως ορίζεται στο παράρτημα I τμήμα Γ 4) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ της οποίας το τελικό υποκείμενο στοιχείο είναι επιτόκιο, ομολογία, δάνειο, οποιοδήποτε καλάθι, χαρτοφυλάκιο ή δείκτης συμπεριλαμβανομένου επιτοκίου, ομολογίας, δανείου ή οποιουδήποτε άλλου προϊόντος που αναπαριστά την απόδοση επιτοκίου, ομολογίας, δανείου.				
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας. Για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εφαρμόζεται το πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, ανάλογα με την περίπτωση**		
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]	**Πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας**
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις επί ομολογιών	μια υποκατηγορία συμβολαίων μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακών συμβάσεων επί ομολογιών ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — εκδότης του υποκείμενου μέσου **Κριτήριο κατάτμησης 2** — η διάρκεια της υποκείμενης παραδοτέας ομολογίας καθορίζεται ως εξής: **Βραχυπρόθεσμο**: μια υποκείμενη παραδοτέα ομολογία με διάρκεια από 1 έως 4 έτη θεωρείται βραχυπρόθεσμη **Μεσοπρόθεσμο**: μια υποκείμενη παραδοτέα ομολογία με διάρκεια από 4 έως 8 έτη θεωρείται μεσοπρόθεσμη **Μακροπρόθεσμο**: μια υποκείμενη παραδοτέα ομολογία με διάρκεια από 8 έως 15 έτη θεωρείται μακροπρόθεσμη **Εξαιρετικά μακροπρόθεσμο**: μια υποκείμενη παραδοτέα ομολογία με διάρκεια μεγαλύτερη των 15 ετών θεωρείται εξαιρετικά μακροπρόθεσμη **Κριτήριο κατάτμησης 3** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του συμβολαίου μελλοντικής εκπλήρωσης ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1**: 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες	5 000 000 ευρώ	10	όποτε για μια υποκατηγορία καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά όσον αφορά ένα συγκεκριμένο κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας, και για την υποκατηγορία που ορίζεται από το επόμενο κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, για την πρώτη σύμβαση προηγούμενου μήνα (back month contract) καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά 2 εβδομάδες πριν από τη λήξη του επόμενου μήνα

▼B

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας. Για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εφαρμόζεται το πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, ανάλογα με την περίπτωση		
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]	**Πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας**
	Κλιμάκιο ληκτότητας 2: 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3**: 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 4**: 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη			
Δικαιώματα προαίρεσης επί ομολογιών	μια υποκατηγορία δικαιωμάτων προαίρεσης επί ομολογιών ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενη ομολογία ή υποκείμενο συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση επί ομολογιών **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του δικαιώματος προαίρεσης ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	5 000 000 ευρώ	10	

▼B

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας. Για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εφαρμόζεται το πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, ανάλογα με την περίπτωση		
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]	**Πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας**
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης και προθεσμιακές συμβάσεις επί επιτοκίων	μια υποκατηγορία συμβολαίων μελλοντικής εκπλήρωσης επί επιτοκίων ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενο επιτόκιο **Κριτήριο κατάτμησης 2** — διάρκεια του υποκείμενου επιτοκίου **Κριτήριο κατάτμησης 3** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του συμβολαίου μελλοντικής εκπλήρωσης ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	500 000 000 ευρώ	10	όποτε για μια υποκατηγορία καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά όσον αφορά ένα συγκεκριμένο κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας, και για την υποκατηγορία που ορίζεται από το επόμενο κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, για την πρώτη σύμβαση προηγούμενου μήνα (back month contract) καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά 2 εβδομάδες πριν από τη λήξη του επόμενου μήνα
Δικαιώματα προαίρεσης επί επιτοκίων	μια υποκατηγορία δικαιωμάτων προαίρεσης επί επιτοκίων ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενο επιτόκιο ή υποκείμενο συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης ή προθεσμιακή συμφωνία επί επιτοκίων **Κριτήριο κατάτμησης 2** — διάρκεια του υποκείμενου επιτοκίου **Κριτήριο κατάτμησης 3** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του δικαιώματος προαίρεσης ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες	500 000 000 ευρώ	10	

▼B

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας. Για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εφαρμόζεται το πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, ανάλογα με την περίπτωση		
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]	**Πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας**
	Κλιμάκιο ληκτότητας 3: 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 1 μήνας < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη			
Δικαιώματα προαίρεσης επί συμφωνιών ανταλλαγής	μια υποκατηγορία δικαιωμάτων προαίρεσης επί συμφωνιών ανταλλαγής ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — το είδος υποκείμενης συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής: συμφωνία ανταλλαγής σταθερού με σταθερό επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα (fixed-to-fixed single currency swap), συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής σταθερού με σταθερό επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα, συμφωνία ανταλλαγής σταθερού με κυμαινόμενο επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα (fixed-to-float single currency swap), συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής σταθερού με κυμαινόμενο επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα, συμφωνία ανταλλαγής κυμαινόμενου με κυμαινόμενο επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα (float-to-float single currency swap), συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής κυμαινόμενου με κυμαινόμενο επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα, συμφωνία ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού στο ίδιο νόμισμα (inflation single currency swap), συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού στο ίδιο νόμισμα, συμφωνία ανταλλαγής OIS στο ίδιο νόμισμα (OIS single currency swap), συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής OIS στο ίδιο νόμισμα, συμφωνία ανταλλαγής σταθερού με σταθερό επιτόκιο σε πολλά νομίσματα (fixed-to-fixed multi currency swap), συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής σταθερού με σταθερό επιτόκιο σε πολλά νομίσματα, συμφωνία ανταλλαγής σταθερού με κυμαινόμενο επιτόκιο σε πολλά νομίσματα (fixed-to-float multi	500 000 000 ευρώ	10	

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας. Για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εφαρμόζεται το πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, ανάλογα με την περίπτωση		
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]	**Πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας**
	currency swap), συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής σταθερού με κυμαινόμενο επιτόκιο σε πολλά νομίσματα, συμφωνία ανταλλαγής κυμαινόμενου με κυμαινόμενο επιτόκιο σε πολλά νομίσματα (float-to-float multi currency swap), συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής κυμαινόμενου με κυμαινόμενο επιτόκιο σε πολλά νομίσματα, συμφωνία ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού σε πολλά νομίσματα (inflation multi-currency swap), συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού σε πολλά νομίσματα, συμφωνία ανταλλαγής OIS σε πολλά νομίσματα (OIS multi-currency swap), συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής OIS σε πολλά νομίσματα **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το ονομαστικό νόμισμα που ορίζεται ως το νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το ονομαστικό ποσό του δικαιώματος προαίρεσης **Κριτήριο κατάτμησης 3** — ο δείκτης του πληθωρισμού, εάν το είδος της υποκείμενης συμφωνίας ανταλλαγής είναι είτε συμφωνία ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού στο ίδιο νόμισμα είτε συμφωνία ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού σε πολλά νομίσματα **Κριτήριο κατάτμησης 4** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 μήνας **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 1 μήνας < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη			

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας. Για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εφαρμόζεται το πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, ανάλογα με την περίπτωση		
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]	**Πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας**
	Κλιμάκιο ληκτότητας 6: 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη			
	Κριτήριο κατάτμησης 5 — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του δικαιώματος προαίρεσης ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 2**: 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 5 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 5 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 10 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 6:** άνω των 10 ετών			
Συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με κυμαινόμενο επιτόκιο σε πολλά νομίσματα (multi-currency swaps) ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής (cross-currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με κυμαινόμενο επιτόκιο σε πολλά νομίσματα ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής	μια υποκατηγορία συμφωνιών ανταλλαγής σταθερού με κυμαινόμενο επιτόκιο σε πολλά νομίσματα (fixed-to-float multi-currency swap) ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — το ονομαστικό ζεύγος νομισμάτων που ορίζεται ως συνδυασμός των δύο νομισμάτων στα οποία εκφράζονται τα δύο σκέλη της συμφωνίας ανταλλαγής **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < ληκτότητα ≤ 1 μήνας **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 1 μήνας < ληκτότητα ≤ 3 μήνες	50 000 000 ευρώ	10	

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας. Για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εφαρμόζεται το πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, ανάλογα με την περίπτωση		
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]	**Πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας**
συμφωνία ανταλλαγής ή συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση σε συμφωνία ανταλλαγής όπου δύο μέρη ανταλλάσσουν ταμειακές ροές που εκφράζονται σε διαφορετικά νομίσματα και οι ταμειακές ροές του ενός σκέλους προσδιορίζονται από σταθερό επιτόκιο, ενώ αυτές του άλλου σκέλους προσδιορίζονται από κυμαινόμενο επιτόκιο	**Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 6 μήνες < ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 1 έτος < ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 6:** 2 έτη < ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m**: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη			
Συμφωνίες ανταλλαγής κυμαινόμενου με κυμαινόμενο επιτόκιο σε πολλά νομίσματα (multi-currency swaps) ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής (cross-currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής κυμαινόμενου με κυμαινόμενο επιτόκιο σε πολλά νομίσματα ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής	μια υποκατηγορία συμφωνιών ανταλλαγής κυμαινόμενου με κυμαινόμενο επιτόκιο σε πολλά νομίσματα (float-to-float multi-currency swap) ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — το ονομαστικό ζεύγος νομισμάτων που ορίζεται ως συνδυασμός των δύο νομισμάτων στα οποία εκφράζονται τα δύο σκέλη της συμφωνίας ανταλλαγής **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < ληκτότητα ≤ 1 μήνας **Κλιμάκιο ληκτότητας 2**: 1 μήνας < ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < ληκτότητα ≤ 6 μήνες	50 000 000 ευρώ	10	

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας. Για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εφαρμόζεται το πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, ανάλογα με την περίπτωση		
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]	**Πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας**
συμφωνία ανταλλαγής ή συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση σε συμφωνία ανταλλαγής όπου δύο μέρη ανταλλάσσουν ταμειακές ροές που εκφράζονται σε διαφορετικά νομίσματα και όπου οι ταμειακές ροές και των δύο σκελών προσδιορίζονται από κυμαινόμενα επιτόκια	**Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 6 μήνες < ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 1 έτος < ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 6:** 2 έτη < ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη			
Συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με σταθερό επιτόκιο σε πολλά νομίσματα (multi-currency swaps) ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής (cross-currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με σταθερό επιτόκιο σε πολλά νομίσματα ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής συμφωνία ανταλλαγής ή συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση σε συμφωνία ανταλλαγής όπου δύο μέρη ανταλλάσσουν ταμειακές ροές που εκφράζονται σε διαφορετικά νομίσματα και όπου οι ταμειακές ροές και των δύο σκελών προσδιορίζονται από σταθερά επιτόκια	μια υποκατηγορία συμφωνιών ανταλλαγής σταθερού με σταθερό επιτόκιο σε πολλά νομίσματα (fixed-to-fixed multi-currency swap) ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — το ονομαστικό ζεύγος νομισμάτων που ορίζεται ως συνδυασμός των δύο νομισμάτων στα οποία εκφράζονται τα δύο σκέλη της συμφωνίας ανταλλαγής **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 μήνας **Κλιμάκιο ληκτότητας 2**: 1 μήνας < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 6:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη	50 000 000 ευρώ	10	

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας. Για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εφαρμόζεται το πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, ανάλογα με την περίπτωση		
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]	**Πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας**
	… **Κλιμάκιο ληκτότητας m**: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη			
Συμφωνία ανταλλαγής δεικτών επιτοκίου διάρκειας μιας ημέρας (overnight index swap, OIS) σε πολλά νομίσματα (multi-currency swaps) ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής (cross-currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής δεικτών επιτοκίου διάρκειας μιας ημέρας (OIS) σε πολλά νομίσματα ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής συμφωνία ανταλλαγής ή συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση σε συμφωνία ανταλλαγής όπου δύο μέρη ανταλλάσσουν ταμειακές ροές που εκφράζονται σε διαφορετικά νομίσματα και όπου οι ταμειακές ροές τουλάχιστον του ενός σκέλους προσδιορίζονται από επιτόκιο βάσει συμφωνίας ανταλλαγής δεικτών επιτοκίου διάρκειας μιας ημέρας (OIS)	μια υποκατηγορία συμφωνιών ανταλλαγής δεικτών επιτοκίου διάρκειας μιας ημέρας (OIS) σε πολλά νομίσματα ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — το ονομαστικό ζεύγος νομισμάτων που ορίζεται ως συνδυασμός των δύο νομισμάτων στα οποία εκφράζονται τα δύο σκέλη της συμφωνίας ανταλλαγής **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 μήνας **Κλιμάκιο ληκτότητας 2**: 1 μήνας < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 6:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m**: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	50 000 000 ευρώ	10	

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας. Για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εφαρμόζεται το πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, ανάλογα με την περίπτωση		
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]	**Πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας**
Συμφωνίες ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού σε πολλά νομίσματα (multi-currency swaps) ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής (cross-currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού σε πολλά νομίσματα ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής συμφωνία ανταλλαγής ή συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση σε συμφωνία ανταλλαγής όπου δύο μέρη ανταλλάσσουν ταμειακές ροές που εκφράζονται σε διαφορετικά νομίσματα και όπου οι ταμειακές ροές τουλάχιστον του ενός σκέλους προσδιορίζονται από επιτόκιο βάσει ποσοστού του πληθωρισμού	μια υποκατηγορία συμφωνιών ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού σε πολλά νομίσματα (inflation multi-currency swap) ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — το ονομαστικό ζεύγος νομισμάτων που ορίζεται ως συνδυασμός των δύο νομισμάτων στα οποία εκφράζονται τα δύο σκέλη της συμφωνίας ανταλλαγής **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 μήνας **Κλιμάκιο ληκτότητας 2**: 1 μήνας < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 6:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m**: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	50 000 000 ευρώ	10	
Συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με κυμαινόμενο επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα (single currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με κυμαινόμενο επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα	μια υποκατηγορία συμφωνιών ανταλλαγής σταθερού με κυμαινόμενο επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα (fixed-to-float single currency swap) ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — το ονομαστικό νόμισμα στο οποίο εκφράζονται τα δύο σκέλη της συμφωνίας ανταλλαγής **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 μήνας	50 000 000 ευρώ	10	

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας. Για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εφαρμόζεται το πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, ανάλογα με την περίπτωση		
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]	**Πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας**
συμφωνία ανταλλαγής ή συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση σε συμφωνία ανταλλαγής όπου δύο μέρη ανταλλάσσουν ταμειακές ροές που εκφράζονται στο ίδιο νόμισμα και οι ταμειακές ροές του ενός σκέλους προσδιορίζονται από σταθερό επιτόκιο, ενώ αυτές του άλλου σκέλους προσδιορίζονται από κυμαινόμενο επιτόκιο	**Κλιμάκιο ληκτότητας 2**: 1 μήνας < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 6:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m**: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη			
Συμφωνίες ανταλλαγής κυμαινόμενου με κυμαινόμενο επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα (single currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής κυμαινόμενου με κυμαινόμενο επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα συμφωνία ανταλλαγής ή συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση σε συμφωνία ανταλλαγής όπου δύο μέρη ανταλλάσσουν ταμειακές ροές που εκφράζονται στο ίδιο νόμισμα και όπου οι ταμειακές ροές και των δύο σκελών προσδιορίζονται από κυμαινόμενα επιτόκια	μια υποκατηγορία συμφωνιών ανταλλαγής κυμαινόμενου με κυμαινόμενο επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα (float-to-float single currency swap) ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — το ονομαστικό νόμισμα στο οποίο εκφράζονται τα δύο σκέλη της συμφωνίας ανταλλαγής **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 μήνας **Κλιμάκιο ληκτότητας 2**: 1 μήνας < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 6:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m**: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	50 000 000 ευρώ	10	

▼B

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας. Για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εφαρμόζεται το πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, ανάλογα με την περίπτωση		
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]	**Πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας**
Συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με σταθερό επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα (single currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με σταθερό επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα συμφωνία ανταλλαγής ή συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση σε συμφωνία ανταλλαγής όπου δύο μέρη ανταλλάσσουν ταμειακές ροές που εκφράζονται στο ίδιο νόμισμα και όπου οι ταμειακές ροές και των δύο σκελών προσδιορίζονται από σταθερά επιτόκια	μια υποκατηγορία συμφωνιών ανταλλαγής σταθερού με σταθερό επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα (fixed-to-fixed single currency swap) ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — το ονομαστικό νόμισμα στο οποίο εκφράζονται τα δύο σκέλη της συμφωνίας ανταλλαγής **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 μήνας **Κλιμάκιο ληκτότητας 2**: 1 μήνας < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 6:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m**: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	50 000 000 ευρώ	10	
Συμφωνία ανταλλαγής δεικτών επιτοκίου διάρκειας μιας ημέρας (OIS) στο ίδιο νόμισμα (single currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής δεικτών επιτοκίου διάρκειας μιας ημέρας (OIS) στο ίδιο νόμισμα	μια υποκατηγορία συμφωνιών ανταλλαγής δεικτών επιτοκίου διάρκειας μιας ημέρας (OIS) στο ίδιο νόμισμα ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — το ονομαστικό νόμισμα στο οποίο εκφράζονται τα δύο σκέλη της συμφωνίας ανταλλαγής **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 μήνας	50 000 000 ευρώ	10	

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας. Για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εφαρμόζεται το πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, ανάλογα με την περίπτωση		
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]	**Πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας**
συμφωνία ανταλλαγής ή συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση σε συμφωνία ανταλλαγής όπου δύο μέρη ανταλλάσσουν ταμειακές ροές που εκφράζονται στο ίδιο νόμισμα και όπου οι ταμειακές ροές τουλάχιστον του ενός σκέλους προσδιορίζονται από επιτόκιο βάσει συμφωνίας ανταλλαγής δεικτών επιτοκίου διάρκειας μιας ημέρας (OIS)	**Κλιμάκιο ληκτότητας 2**: 1 μήνας < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 6:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m**: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη			
Συμφωνίες ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού στο ίδιο νόμισμα (single currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού στο ίδιο νόμισμα συμφωνία ανταλλαγής ή συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση σε συμφωνία ανταλλαγής όπου δύο μέρη ανταλλάσσουν ταμειακές ροές που εκφράζονται στο ίδιο νόμισμα και όπου οι ταμειακές ροές τουλάχιστον του ενός σκέλους προσδιορίζονται από επιτόκιο βάσει ποσοστού του πληθωρισμού	μια υποκατηγορία συμφωνιών ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού στο ίδιο νόμισμα (inflation single-currency swap) ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — το ονομαστικό νόμισμα στο οποίο εκφράζονται τα δύο σκέλη της συμφωνίας ανταλλαγής **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 μήνας **Κλιμάκιο ληκτότητας 2**: 1 μήνας < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες	50 000 000 ευρώ	10	

▼B

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας. Για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εφαρμόζεται το πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, ανάλογα με την περίπτωση		
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]	**Πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας**
	Κλιμάκιο ληκτότητας 4: 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 6:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m**: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη			
Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί επιτοκίων				
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εφαρμόζεται η ακόλουθη μεθοδολογία**			
Άλλα παράγωγα επί επιτοκίων παράγωγο επί επιτοκίων που δεν ανήκει σε καμία από τις ανωτέρω κατηγορίες επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	οποιοδήποτε άλλο παράγωγο επί επιτοκίων για το οποίο θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά			

▼B

Πίνακας 5.2

Παράγωγα επί επιτοκίων — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί επιτοκίων														
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για κάθε υποκατηγορία για την οποία καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**													
	Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων	**Προσυναλλακτικό SSTI**					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**			**Μετασυναλλακτικό LIS**		
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις επί ομολογιών	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	4 000 000 ευρώ	70	5 000 000 ευρώ	80	60	20 000 000 ευρώ	90	70	25 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									
Δικαιώματα προαίρεσης επί ομολογιών	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	4 000 000 ευρώ	70	5 000 000 ευρώ	80	60	20 000 000 ευρώ	90	70	25 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί επιτοκίων														
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για κάθε υποκατηγορία για την οποία καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**													
	Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων	**Προσυναλλακτικό SSTI**					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**			**Μετασυναλλακτικό LIS**		
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης και προθεσμιακές συμβάσεις επί επιτοκίων	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	5 000 000 ευρώ	70	10 000 000 ευρώ	80	60	20 000 000 ευρώ	90	70	25 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									
Δικαιώματα προαίρεσης επί επιτοκίων	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	5 000 000 ευρώ	70	10 000 000 ευρώ	80	60	20 000 000 ευρώ	90	70	25 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί επιτοκίων														
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για κάθε υποκατηγορία για την οποία καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**													
	Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων	**Προσυναλλακτικό SSTI**					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**			**Μετασυναλλακτικό LIS**		
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Δικαιώματα προαίρεσης επί συμφωνιών ανταλλαγής	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	4 000 000 ευρώ	70	5 000 000 ευρώ	80	60	9 000 000 ευρώ	90	70	10 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									
Συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με κυμαινόμενο επιτόκιο σε πολλά νομίσματα (multi-currency swaps) ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής (cross-currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με κυμαινόμενο επιτόκιο σε πολλά νομίσματα ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	4 000 000 ευρώ	70	5 000 000 ευρώ	80	60	9 000 000 ευρώ	90	70	10 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί επιτοκίων														
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για κάθε υποκατηγορία για την οποία καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**													
	Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων	**Προσυναλλακτικό SSTI**					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**			**Μετασυναλλακτικό LIS**		
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Συμφωνίες ανταλλαγής κυμαινόμενου με κυμαινόμενο επιτόκιο σε πολλά νομίσματα (multi-currency swaps) ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής (cross-currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής κυμαινόμενου με κυμαινόμενο επιτόκιο σε πολλά νομίσματα ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	4 000 000 ευρώ	70	5 000 000 ευρώ	80	60	9 000 000 ευρώ	90	70	10 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									
Συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με σταθερό επιτόκιο σε πολλά νομίσματα (multi-currency swaps) ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής (cross-currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με σταθερό επιτόκιο σε πολλά νομίσματα ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	4 000 000 ευρώ	70	5 000 000 ευρώ	80	60	9 000 000 ευρώ	90	70	10 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί επιτοκίων														
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για κάθε υποκατηγορία για την οποία καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**													
	Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων	**Προσυναλλακτικό SSTI**					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**			**Μετασυναλλακτικό LIS**		
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Συμφωνία ανταλλαγής δεικτών επιτοκίου διάρκειας μιας ημέρας (overnight index swap, OIS) σε πολλά νομίσματα (multi-currency swaps) ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής (cross-currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής δεικτών επιτοκίου διάρκειας μιας ημέρας (OIS) σε πολλά νομίσματα ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	4 000 000 ευρώ	70	5 000 000 ευρώ	80	60	9 000 000 ευρώ	90	70	10 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									
Συμφωνίες ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού σε πολλά νομίσματα (multi-currency swaps) ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής (cross-currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού σε πολλά νομίσματα ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	4 000 000 ευρώ	70	5 000 000 ευρώ	80	60	9 000 000 ευρώ	90	70	10 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί επιτοκίων														
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για κάθε υποκατηγορία για την οποία καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**													
	Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων	**Προσυναλλακτικό SSTI**					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**			**Μετασυναλλακτικό LIS**		
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με κυμαινόμενο επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα (single currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με κυμαινόμενο επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	4 000 000 ευρώ	70	5 000 000 ευρώ	80	60	9 000 000 ευρώ	90	70	10 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									
Συμφωνίες ανταλλαγής κυμαινόμενου με κυμαινόμενο επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα (single currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής κυμαινόμενου με κυμαινόμενο επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	4 000 000 ευρώ	70	5 000 000 ευρώ	80	60	9 000 000 ευρώ	90	70	10 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί επιτοκίων														
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για κάθε υποκατηγορία για την οποία καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**													
	Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων	**Προσυναλλακτικό SSTI**					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**			**Μετασυναλλακτικό LIS**		
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με σταθερό επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα (single currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με σταθερό επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	4 000 000 ευρώ	70	5 000 000 ευρώ	80	60	9 000 000 ευρώ	90	70	10 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									
Συμφωνία ανταλλαγής δεικτών επιτοκίου διάρκειας μιας ημέρας (OIS) στο ίδιο νόμισμα (single currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής δεικτών επιτοκίου διάρκειας μιας ημέρας (OIS) στο ίδιο νόμισμα	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	4 000 000 ευρώ	70	5 000 000 ευρώ	80	60	9 000 000 ευρώ	90	70	10 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί επιτοκίων														
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για κάθε υποκατηγορία για την οποία καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**													
	Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων	**Προσυναλλακτικό SSTI**					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**			**Μετασυναλλακτικό LIS**		
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Συμφωνίες ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού στο ίδιο νόμισμα (single currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού στο ίδιο νόμισμα	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	4 000 000 ευρώ	70	5 000 000 ευρώ	80	60	9 000 000 ευρώ	90	70	10 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									

Πίνακας 5.3

Παράγωγα επί επιτοκίων — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί επιτοκίων				
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για κάθε υποκατηγορία για την οποία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά**			
	Προσυναλλακτικό SSTI	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
	Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις επί ομολογιών	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	20 000 000 ευρώ	25 000 000 ευρώ
Δικαιώματα προαίρεσης επί ομολογιών	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	20 000 000 ευρώ	25 000 000 ευρώ
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης και προθεσμιακές συμβάσεις επί επιτοκίων	5 000 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ	20 000 000 ευρώ	25 000 000 ευρώ

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί επιτοκίων				
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για κάθε υποκατηγορία για την οποία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά**			
	Προσυναλλακτικό SSTI	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
	Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
Δικαιώματα προαίρεσης επί επιτοκίων	5 000 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ	20 000 000 ευρώ	25 000 000 ευρώ
Δικαιώματα προαίρεσης επί συμφωνιών ανταλλαγής	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	9 000 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ
Συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με κυμαινόμενο επιτόκιο σε πολλά νομίσματα (multi-currency swaps) ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής (cross-currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με κυμαινόμενο επιτόκιο σε πολλά νομίσματα ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	9 000 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ
Συμφωνίες ανταλλαγής κυμαινόμενου με κυμαινόμενο επιτόκιο σε πολλά νομίσματα (multi-currency swaps) ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής (cross-currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής κυμαινόμενου με κυμαινόμενο επιτόκιο σε πολλά νομίσματα ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	9 000 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ
Συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με σταθερό επιτόκιο σε πολλά νομίσματα (multi-currency swaps) ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής (cross-currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με σταθερό επιτόκιο σε πολλά νομίσματα ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	9 000 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ
Συμφωνία ανταλλαγής δεικτών επιτοκίου διάρκειας μιας ημέρας (overnight index swap, OIS) σε πολλά νομίσματα (multi-currency swaps) ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής (cross-currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής δεικτών επιτοκίου διάρκειας μιας ημέρας (OIS) σε πολλά νομίσματα ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	9 000 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ
Συμφωνίες ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού σε πολλά νομίσματα (multi-currency swaps) ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής (cross-currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού σε πολλά νομίσματα ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	9 000 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ
Συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με κυμαινόμενο επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα (single currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με κυμαινόμενο επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	9 000 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί επιτοκίων				
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για κάθε υποκατηγορία για την οποία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά**			
	Προσυναλλακτικό SSTI	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
	Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
Συμφωνίες ανταλλαγής κυμαινόμενου με κυμαινόμενο επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα (single currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής κυμαινόμενου με κυμαινόμενο επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	9 000 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ
Συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με σταθερό επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα (single currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής σταθερού με σταθερό επιτόκιο στο ίδιο νόμισμα	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	9 000 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ
Συμφωνία ανταλλαγής δεικτών επιτοκίου διάρκειας μιας ημέρας (OIS) στο ίδιο νόμισμα (single currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής δεικτών επιτοκίου διάρκειας μιας ημέρας (OIS) στο ίδιο νόμισμα	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	9 000 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ
Συμφωνίες ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού στο ίδιο νόμισμα (single currency swaps) και συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού στο ίδιο νόμισμα	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	9 000 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ
Άλλα παράγωγα επί επιτοκίων	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	9 000 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ

6. **Παράγωγα επί μετοχών**

Πίνακας 6.1

Παράγωγα επί μετοχών — κατηγορίες για τις οποίες δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών
οποιαδήποτε σύμβαση, όπως ορίζεται στο παράρτημα I τμήμα Γ 4) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ που σχετίζεται με:
α) μία ή περισσότερες μετοχές, πιστοποιητικά αποθετηρίου, διαπραγματεύσιμα αμοιβαία κεφάλαια (ΔΑΚ/ETF), πιστοποιητικά, άλλα παρόμοια χρηματοπιστωτικά μέσα, ταμειακές ροές ή άλλα προϊόντα που σχετίζονται με την απόδοση μιας ή περισσοτέρων μετοχών, πιστοποιητικών αποθετηρίου, ΔΑΚ, πιστοποιητικών ή άλλων παρόμοιων χρηματοπιστωτικών μέσων·
β) δείκτη μετοχών, πιστοποιητικών αποθετηρίου, ΔΑΚ, πιστοποιητικών, άλλων παρόμοιων χρηματοπιστωτικών μέσων, ταμειακών ροών ή άλλων προϊόντων που σχετίζονται με την απόδοση μιας ή περισσοτέρων μετοχών, πιστοποιητικών αποθετηρίου, ΔΑΚ, πιστοποιητικών ή άλλων παρόμοιων χρηματοπιστωτικών μέσων

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών	
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εφαρμόζεται η ακόλουθη μεθοδολογία**
Δικαιώματα προαίρεσης με βάση χρηματιστηριακό δείκτη δικαίωμα προαίρεσης του οποίου το υποκείμενο στοιχείο είναι δείκτης αποτελούμενος από μετοχές	για όλα τα δικαιώματα προαίρεσης επί δείκτη θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις με βάση χρηματιστηριακό δείκτη συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι δείκτης αποτελούμενος από μετοχές	για όλα τα συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις επί δείκτη θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά
Δικαιώματα προαίρεσης μετοχών δικαίωμα προαίρεσης του οποίου το υποκείμενο στοιχείο είναι μετοχή ή καλάθι μετοχών που προκύπτει από εταιρική πράξη	για όλα τα δικαιώματα προαίρεσης μετοχών θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις μετοχών συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι μετοχή ή καλάθι μετοχών που προκύπτει από εταιρική πράξη	για όλα τα συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις μετοχών θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά
Δικαιώματα προαίρεσης μερισμάτων μετοχών δικαίωμα προαίρεσης επί του μερίσματος μιας συγκεκριμένης μετοχής	για όλα τα δικαιώματα προαίρεσης μερισμάτων μετοχών θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις μερισμάτων μετοχών συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση επί του μερίσματος μιας συγκεκριμένης μετοχής	για όλα τα συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις μερισμάτων μετοχών θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά
Δικαιώματα προαίρεσης με βάση δείκτη μερισμάτων δικαίωμα προαίρεσης επί δείκτη αποτελούμενου από μερίσματα μιας ή περισσότερων μετοχών	για όλα τα δικαιώματα προαίρεσης επί δείκτη μερισμάτων θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις με βάση δείκτη μερισμάτων συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση επί δείκτη αποτελούμενου από μερίσματα μιας ή περισσότερων μετοχών	για όλα τα συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις επί δείκτη μερισμάτων θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά
Δικαιώματα προαίρεσης με βάση δείκτη μεταβλητότητας δικαίωμα προαίρεσης του οποίου το υποκείμενο στοιχείο είναι ένας δείκτης μεταβλητότητας, ο οποίος ορίζεται ως δείκτης που σχετίζεται με τη μεταβλητότητα ενός συγκεκριμένου υποκείμενου δείκτη μετοχικών τίτλων	για όλα τα δικαιώματα προαίρεσης επί δείκτη μεταβλητότητας θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών	
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις με βάση δείκτη μεταβλητότητας συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση του οποίου το υποκείμενο στοιχείο είναι ένας δείκτης μεταβλητότητας, ο οποίος ορίζεται ως δείκτης που σχετίζεται με τη μεταβλητότητα ενός συγκεκριμένου υποκείμενου δείκτη μετοχικών τίτλων	για όλα τα συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις επί δείκτη μεταβλητότητας θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά
Δικαιώματα προαίρεσης επί ETF δικαίωμα προαίρεσης του οποίου το υποκείμενο στοιχείο είναι ένα διαπραγματεύσιμο αμοιβαίο κεφάλαιο (ΔΑΚ/ETF)	για όλα τα δικαιώματα προαίρεσης επί ETF θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις επί ETF συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι ένα διαπραγματεύσιμο αμοιβαίο κεφάλαιο (ΔΑΚ/ETF)	για όλα τα συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις επί ETF θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών			
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας**	
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
Συμφωνίες ανταλλαγής	μια υποκατηγορία συμφωνιών ανταλλαγής ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — είδος υποκείμενου στοιχείου: μεμονωμένος πιστούχος, δείκτης, καλάθι **Κριτήριο κατάτμησης 2** — υποκείμενος μεμονωμένος πιστούχος, δείκτης, καλάθι **Κριτήριο κατάτμησης 3** — παράμετρος: βασική παράμετρος απόδοσης με επιστροφή του αντιτίμου, παράμετρος μερισματικής απόδοσης, παράμετρος διακύμανσης της απόδοσης, παράμετρος μεταβλητότητας της απόδοσης **Κριτήριο κατάτμησης 4** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής:	50 000 000 ευρώ	15

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών					
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**			**Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας**	
				Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
	Βασική παράμετρος απόδοσης με επιστροφή του αντιτίμου	Παράμετρος διακύμανσης/μεταβλητότητας της απόδοσης	Παράμετρος μερισματικής απόδοσης		
	Κλιμάκιο ληκτότητας 1: 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 μήνας	**Κλιμάκιο ληκτότητας 1**: 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες	**Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος		
	Κλιμάκιο ληκτότητας 2: 1 μήνας < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες	**Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες	**Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη		
	Κλιμάκιο ληκτότητας 3: 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες	**Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος	**Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη		
	Κλιμάκιο ληκτότητας 4: 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος	**Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη	…		
	Κλιμάκιο ληκτότητας 5: 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη	**Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη	**Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη		
	Κλιμάκιο ληκτότητας 6: 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη	…			
	…	**Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη			
	Κλιμάκιο ληκτότητας m: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη				

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών			
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας**	
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
Συμφωνίες ανταλλαγής χαρτοφυλακίου	μια υποκατηγορία συμφωνιών ανταλλαγής χαρτοφυλακίου ορίζεται από έναν συγκεκριμένο συνδυασμό των εξής: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — είδος υποκείμενου στοιχείου: μεμονωμένος πιστούχος, δείκτης, καλάθι **Κριτήριο κατάτμησης 2** — υποκείμενος μεμονωμένος πιστούχος, δείκτης, καλάθι **Κριτήριο κατάτμησης 3** — παράμετρος: βασική παράμετρος απόδοσης με επιστροφή του αντιτίμου, παράμετρος μερισματικής απόδοσης, παράμετρος διακύμανσης της απόδοσης, παράμετρος μεταβλητότητας της απόδοσης **Κριτήριο κατάτμησης 4** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής χαρτοφυλακίου ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 μήνας **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 1 μήνας < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 6:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	50 000 000 ευρώ	15

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών	
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εφαρμόζεται η ακόλουθη μεθοδολογία**
Άλλα παράγωγα επί μετοχών	
παράγωγο επί μετοχών που δεν ανήκει σε καμία από τις ανωτέρω κατηγορίες επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	οποιοδήποτε άλλο παράγωγο επί μετοχών για το οποίο θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά

▼B

Πίνακας 6.2

Παράγωγα επί μετοχών — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών							
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS, κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων**	**Τιμές των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για τις υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, με βάση τη ζώνη του μέσου ημερήσιου ονομαστικού ποσού (ADNA) στην οποία ανήκει η υποκατηγορία**				
			Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA)	**Προσυναλλακτικό SSTI**	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
				Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
Δικαιώματα προαίρεσης με βάση χρηματιστηριακό δείκτη	μια υποκατηγορία δικαιωμάτων προαίρεσης με βάση χρηματιστηριακό δείκτη ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενος δείκτης μετοχών	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	**< 100 εκατ. ευρώ ADNA**	20 000 ευρώ	25 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ
			100 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 200 εκατ. ευρώ	2 500 000 ευρώ	3 000 000 ευρώ	25 000 000 ευρώ	30 000 000 ευρώ
			200 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 600 εκατ. ευρώ	5 000 000 ευρώ	5 500 000 ευρώ	50 000 000 ευρώ	55 000 000 ευρώ
			ADNA ≥ 600 εκατ. ευρώ	15 000 000 ευρώ	20 000 000 ευρώ	150 000 000 ευρώ	160 000 000 ευρώ
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις με βάση χρηματιστηριακό δείκτη	μια υποκατηγορία συμβολαίων μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακών συμβάσεων με βάση χρηματιστηριακό δείκτη ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενος δείκτης μετοχών	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	**< 100 εκατ. ευρώ ADNA**	20 000 ευρώ	25 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ
			100 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 1 δισεκατ. ευρώ	500 000 ευρώ	550 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	5 500 000 ευρώ

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών							
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS, κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων**	**Τιμές των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για τις υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, με βάση τη ζώνη του μέσου ημερήσιου ονομαστικού ποσού (ADNA) στην οποία ανήκει η υποκατηγορία**				
			Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA)	**Προσυναλλακτικό SSTI**	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
				Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
			1 δισεκατ. ευρώ ≤ ADNA < 3 δισεκατ. ευρώ	5 000 000 ευρώ	5 500 000 ευρώ	50 000 000 ευρώ	55 000 000 ευρώ
			3 δισεκατ. ευρώ ≤ ADNA < 5 δισεκατ. ευρώ	15 000 000 ευρώ	20 000 000 ευρώ	150 000 000 ευρώ	160 000 000 ευρώ
			ADNA ≥ 5 δισεκατ. ευρώ	25 000 000 ευρώ	30 000 000 ευρώ	250 000 000 ευρώ	260 000 000 ευρώ
Δικαιώματα προαίρεσης μετοχών	μια υποκατηγορία δικαιωμάτων προαίρεσης επί μετοχών ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενη μετοχή	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	**< 5 εκατ. ευρώ ADNA**	20 000 ευρώ	25 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ	1 250 000 ευρώ
			5 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 10 εκατ. ευρώ	250 000 ευρώ	300 000 ευρώ	1 250 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ
			10 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 20 εκατ. ευρώ	500 000 ευρώ	550 000 ευρώ	2 500 000 ευρώ	3 000 000 ευρώ
			ADNA ≥ 20 εκατ. ευρώ	1 000 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	5 500 000 ευρώ

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών							
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS, κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων**	**Τιμές των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για τις υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, με βάση τη ζώνη του μέσου ημερήσιου ονομαστικού ποσού (ADNA) στην οποία ανήκει η υποκατηγορία**				
			Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA)	**Προσυναλλακτικό SSTI**	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
				Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις μετοχών	μια υποκατηγορία συμβολαίων μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακών συμβάσεων επί μετοχών ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενη μετοχή	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	**< 5 εκατ. ευρώ ADNA**	20 000 ευρώ	25 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ	1 250 000 ευρώ
			5 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 10 εκατ. ευρώ	250 000 ευρώ	300 000 ευρώ	1 250 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ
			10 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 20 εκατ. ευρώ	500 000 ευρώ	550 000 ευρώ	2 500 000 ευρώ	3 000 000 ευρώ
			ADNA ≥ 20 εκατ. ευρώ	1 000 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	5 500 000 ευρώ
Δικαιώματα προαίρεσης μερισμάτων μετοχών	μια υποκατηγορία δικαιωμάτων προαίρεσης επί μερισμάτων μετοχών ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενη μετοχή με δικαίωμα στη διανομή μερίσματος	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	**< 5 εκατ. ευρώ ADNA**	20 000 ευρώ	25 000 ευρώ	400 000 ευρώ	450 000 ευρώ
			5 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 10 εκατ. ευρώ	25 000 ευρώ	30 000 ευρώ	500 000 ευρώ	550 000 ευρώ
			10 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 20 εκατ. ευρώ	50 000 ευρώ	100 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ
			ADNA ≥ 20 εκατ. ευρώ	100 000 ευρώ	150 000 ευρώ	2 000 000 ευρώ	2 500 000 ευρώ

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών							
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS, κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων**	**Τιμές των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για τις υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, με βάση τη ζώνη του μέσου ημερήσιου ονομαστικού ποσού (ADNA) στην οποία ανήκει η υποκατηγορία**				
			Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA)	**Προσυναλλακτικό SSTI**	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
				Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις μερισμάτων μετοχών	μια υποκατηγορία συμβολαίων μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακών συμβάσεων επί μερισμάτων μετοχών ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενη μετοχή με δικαίωμα στη διανομή μερίσματος	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	**< 5 εκατ. ευρώ ADNA**	20 000 ευρώ	25 000 ευρώ	400 000 ευρώ	450 000 ευρώ
			5 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 10 εκατ. ευρώ	25 000 ευρώ	30 000 ευρώ	500 000 ευρώ	550 000 ευρώ
			10 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 20 εκατ. ευρώ	50 000 ευρώ	100 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ
			ADNA ≥ 20 εκατ. ευρώ	100 000 ευρώ	150 000 ευρώ	2 000 000 ευρώ	2 500 000 ευρώ
Δικαιώματα προαίρεσης με βάση δείκτη μερισμάτων	μια υποκατηγορία δικαιωμάτων προαίρεσης με βάση δείκτη μερισμάτων ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενος δείκτης μερισμάτων	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	**< 100 εκατ. ευρώ ADNA**	20 000 ευρώ	25 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ
			100 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 200 εκατ. ευρώ	2 500 000 ευρώ	3 000 000 ευρώ	25 000 000 ευρώ	30 000 000 ευρώ
			200 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 600 εκατ. ευρώ	5 000 000 ευρώ	5 500 000 ευρώ	50 000 000 ευρώ	55 000 000 ευρώ
			ADNA ≥ 600 εκατ. ευρώ	15 000 000 ευρώ	20 000 000 ευρώ	150 000 000 ευρώ	160 000 000 ευρώ

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών							
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS, κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων**	**Τιμές των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για τις υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, με βάση τη ζώνη του μέσου ημερήσιου ονομαστικού ποσού (ADNA) στην οποία ανήκει η υποκατηγορία**				
			Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA)	**Προσυναλλακτικό SSTI**	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
				Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις με βάση δείκτη μερισμάτων	μια υποκατηγορία συμβολαίων μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακών συμβάσεων με βάση δείκτη μερισμάτων ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενος δείκτης μερισμάτων	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	**< 100 εκατ. ευρώ ADNA**	20 000 ευρώ	25 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ
			100 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 1 δισεκατ. ευρώ	500 000 ευρώ	550 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	5 500 000 ευρώ
			1 δισεκατ. ευρώ ≤ ADNA < 3 δισεκατ. ευρώ	5 000 000 ευρώ	5 500 000 ευρώ	50 000 000 ευρώ	55 000 000 ευρώ
			3 δισεκατ. ευρώ ≤ ADNA < 5 δισεκατ. ευρώ	15 000 000 ευρώ	20 000 000 ευρώ	150 000 000 ευρώ	160 000 000 ευρώ
			ADNA ≥ 5 δισεκατ. ευρώ	25 000 000 ευρώ	30 000 000 ευρώ	250 000 000 ευρώ	260 000 000 ευρώ
Δικαιώματα προαίρεσης με βάση δείκτη μεταβλητότητας	μια υποκατηγορία δικαιωμάτων προαίρεσης με βάση δείκτη μεταβλητότητας ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενος δείκτης μεταβλητότητας	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	**< 100 εκατ. ευρώ ADNA**	20 000 ευρώ	25 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ
			100 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 200 εκατ. ευρώ	2 500 000 ευρώ	3 000 000 ευρώ	25 000 000 ευρώ	30 000 000 ευρώ
			200 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 600 εκατ. ευρώ	5 000 000 ευρώ	5 500 000 ευρώ	50 000 000 ευρώ	55 000 000 ευρώ
			ADNA ≥ 600 εκατ. ευρώ	15 000 000 ευρώ	20 000 000 ευρώ	150 000 000 ευρώ	160 000 000 ευρώ

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών							
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS, κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων**	**Τιμές των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για τις υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, με βάση τη ζώνη του μέσου ημερήσιου ονομαστικού ποσού (ADNA) στην οποία ανήκει η υποκατηγορία**				
			Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA)	**Προσυναλλακτικό SSTI**	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
				Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις με βάση δείκτη μεταβλητότητας	μια υποκατηγορία συμβολαίων μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακών συμβάσεων με βάση δείκτη μεταβλητότητας ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενος δείκτης μεταβλητότητας	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	**< 100 εκατ. ευρώ ADNA**	20 000 ευρώ	25 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ
			100 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 1 δισεκατ. ευρώ	500 000 ευρώ	550 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	5 500 000 ευρώ
			1 δισεκατ. ευρώ ≤ ADNA < 3 δισεκατ. ευρώ	5 000 000 ευρώ	5 500 000 ευρώ	50 000 000 ευρώ	55 000 000 ευρώ
			3 δισεκατ. ευρώ ≤ ADNA < 5 δισεκατ. ευρώ	15 000 000 ευρώ	20 000 000 ευρώ	150 000 000 ευρώ	160 000 000 ευρώ
			ADNA ≥ 5 δισεκατ. ευρώ	25 000 000 ευρώ	30 000 000 ευρώ	250 000 000 ευρώ	260 000 000 ευρώ
Δικαιώματα προαίρεσης επί ETF	μια υποκατηγορία δικαιωμάτων προαίρεσης επί ETF ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενο ETF	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	**< 5 εκατ. ευρώ ADNA**	20 000 ευρώ	25 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ	1 250 000 ευρώ
			5 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 10 εκατ. ευρώ	250 000 ευρώ	300 000 ευρώ	1 250 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ
			10 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 20 εκατ. ευρώ	500 000 ευρώ	550 000 ευρώ	2 500 000 ευρώ	3 000 000 ευρώ
			ADNA ≥ 20 εκατ. ευρώ	1 000 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	5 500 000 ευρώ

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών							
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS, κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων**	**Τιμές των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για τις υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, με βάση τη ζώνη του μέσου ημερήσιου ονομαστικού ποσού (ADNA) στην οποία ανήκει η υποκατηγορία**				
			Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA)	**Προσυναλλακτικό SSTI**	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
				Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις επί ETF	μια υποκατηγορία συμβολαίων μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακών συμβάσεων επί ETF ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενο ETF	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	**< 5 εκατ. ευρώ ADNA**	20 000 ευρώ	25 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ	1 250 000 ευρώ
			5 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 10 εκατ. ευρώ	250 000 ευρώ	300 000 ευρώ	1 250 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ
			10 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 20 εκατ. ευρώ	500 000 ευρώ	550 000 ευρώ	2 500 000 ευρώ	3 000 000 ευρώ
			ADNA ≥ 20 εκατ. ευρώ	1 000 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	5 500 000 ευρώ
Συμφωνίες ανταλλαγής	μια υποκατηγορία συμφωνιών ανταλλαγής ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — είδος υποκείμενου στοιχείου: μεμονωμένος πιστούχος, δείκτης, καλάθι **Κριτήριο κατάτμησης 2** — υποκείμενος μεμονωμένος πιστούχος, δείκτης, καλάθι **Κριτήριο κατάτμησης 3** — παράμετρος: βασική παράμετρος απόδοσης με επιστροφή του αντιτίμου, παράμετρος μερισματικής απόδοσης, παράμετρος διακύμανσης της απόδοσης, παράμετρος μεταβλητότητας της απόδοσης **Κριτήριο κατάτμησης 4** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής:	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	**50 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 100 εκατ. ευρώ**	250 000 ευρώ	300 000 ευρώ	1 250 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ
			100 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 200 εκατ. ευρώ	500 000 ευρώ	550 000 ευρώ	2 500 000 ευρώ	3 000 000 ευρώ
			ADNA ≥ 200 εκατ. ευρώ	1 000 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	5 500 000 ευρώ

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών									
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS, κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**			**Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων**	**Τιμές των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για τις υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, με βάση τη ζώνη του μέσου ημερήσιου ονομαστικού ποσού (ADNA) στην οποία ανήκει η υποκατηγορία**				
					Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA)	**Προσυναλλακτικό SSTI**	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
						Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
	Βασική παράμετρος απόδοσης με επιστροφή του αντιτίμου	**Παράμετρος διακύμανσης/ μεταβλητότητας της απόδοσης**	**Παράμετρος μερισματικής απόδοσης**						
	Κλιμάκιο ληκτότητας 1: 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 μήνας	**Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες	**Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος						
	Κλιμάκιο ληκτότητας 2: 1 μήνας < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες	**Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες	**Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη						
	Κλιμάκιο ληκτότητας 3: 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες	**Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος	**Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη						

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών									
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS, κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**			**Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων**	**Τιμές των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για τις υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, με βάση τη ζώνη του μέσου ημερήσιου ονομαστικού ποσού (ADNA) στην οποία ανήκει η υποκατηγορία**				
					Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA)	**Προσυναλλακτικό SSTI**	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
						Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
	Κλιμάκιο ληκτότητας 4: 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος	**Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη	…						
	Κλιμάκιο ληκτότητας 5: 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη	**Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη	**Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη						
	Κλιμάκιο ληκτότητας 6: 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη	…							
	…	**Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη							
	Κλιμάκιο ληκτότητας m: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη								

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών							
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS, κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων**	**Τιμές των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για τις υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, με βάση τη ζώνη του μέσου ημερήσιου ονομαστικού ποσού (ADNA) στην οποία ανήκει η υποκατηγορία**				
			Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA)	**Προσυναλλακτικό SSTI**	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
				Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
Συμφωνίες ανταλλαγής χαρτοφυλακίου	μια υποκατηγορία συμφωνιών ανταλλαγής χαρτοφυλακίου ορίζεται από έναν συγκεκριμένο συνδυασμό των εξής: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — είδος υποκείμενου στοιχείου: μεμονωμένος πιστούχος, δείκτης, καλάθι **Κριτήριο κατάτμησης 2** — υποκείμενος μεμονωμένος πιστούχος, δείκτης, καλάθι **Κριτήριο κατάτμησης 3** — παράμετρος: βασική παράμετρος απόδοσης με επιστροφή του αντιτίμου, παράμετρος μερισματικής απόδοσης, παράμετρος διακύμανσης της απόδοσης, παράμετρος μεταβλητότητας της απόδοσης **Κριτήριο κατάτμησης 4** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής χαρτοφυλακίου ορίζεται ως εξής:	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	**50 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 100 εκατ. ευρώ**	250 000 ευρώ	300 000 ευρώ	1 250 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ
			100 εκατ. ευρώ ≤ ADNA < 200 εκατ. ευρώ	500 000 ευρώ	550 000 ευρώ	2 500 000 ευρώ	3 000 000 ευρώ
			ADNA ≥ 200 εκατ. ευρώ	1 000 000 ευρώ	1 500 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	5 500 000 ευρώ
	Κλιμάκιο ληκτότητας 1: 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 μήνας						
	Κλιμάκιο ληκτότητας 2: 1 μήνας < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες						
	Κλιμάκιο ληκτότητας 3: 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες						

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών							
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS, κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων**	**Τιμές των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για τις υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, με βάση τη ζώνη του μέσου ημερήσιου ονομαστικού ποσού (ADNA) στην οποία ανήκει η υποκατηγορία**				
			Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA)	**Προσυναλλακτικό SSTI**	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
				Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
	Κλιμάκιο ληκτότητας 4: 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος						
	Κλιμάκιο ληκτότητας 5: 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη						
	Κλιμάκιο ληκτότητας 6: 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη						
	…						
	Κλιμάκιο ληκτότητας m: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη						

Πίνακας 6.3

Παράγωγα επί μετοχών — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί μετοχών				
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά**			
	Προσυναλλακτικό SSTI	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
	Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
Συμφωνίες ανταλλαγής	20 000 ευρώ	25 000 ευρώ	100 000 ευρώ	150 000 ευρώ
Συμφωνίες ανταλλαγής χαρτοφυλακίου	20 000 ευρώ	25 000 ευρώ	100 000 ευρώ	150 000 ευρώ
Άλλα παράγωγα επί μετοχών	20 000 ευρώ	25 000 ευρώ	100 000 ευρώ	150 000 ευρώ

▼B

7. **Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων·**

Πίνακας 7.1

Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων — κατηγορίες για τις οποίες δεν υπάρχει ρευστή αγορά

<table>
<tr><td colspan="4">Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού</td><td rowspan="2">Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω</td><td colspan="2">Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας</td></tr>
<tr><td>Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]</td><td>Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]</td></tr>
<tr><td>Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις επί εμπορευμάτων μετάλλων</td><td>μια υποκατηγορία συμβολαίων μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακών συμβάσεων επί εμπορευμάτων μετάλλων ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης:
Κριτήριο κατάτμησης 1 — τύπος μετάλλου: πολύτιμα μέταλλα, μη πολύτιμα μέταλλα
Κριτήριο κατάτμησης 2 — υποκείμενο μέταλλο
Κριτήριο κατάτμησης 3 — το ονομαστικό νόμισμα που ορίζεται ως το νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το ονομαστικό ποσό του συμβολαίου μελλοντικής εκπλήρωσης/της προθεσμιακής σύμβασης
Κριτήριο κατάτμησης 4 — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του συμβολαίου μελλοντικής εκπλήρωσης/της προθεσμιακής σύμβασης ορίζεται ως εξής:
<table><tr><td>Πολύτιμα μέταλλα</td><td>Μη πολύτιμα μέταλλα</td><td></td></tr><tr><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 1: 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες</td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 1: 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος</td><td></td></tr><tr><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 2: 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος</td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 2: 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη</td><td></td></tr><tr><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 3: 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη</td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 3: 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη</td><td></td></tr></table></td><td>10 000 000 ευρώ</td><td>10</td></tr>
</table>

<table>
<tr><td colspan="5">Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού</td><td colspan="3" rowspan="2">Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω</td><td colspan="2">Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας</td></tr>
<tr><td>Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]</td><td>Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]</td></tr>
<tr><td></td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 4: 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη</td><td>…</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>…</td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας m: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας m: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη</td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>Δικαιώματα προαίρεσης επί εμπορευμάτων μετάλλων</td><td colspan="3">μια υποκατηγορία δικαιωμάτων προαίρεσης επί εμπορευμάτων μετάλλων ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης:
Κριτήριο κατάτμησης 1 — τύπος μετάλλου: πολύτιμα μέταλλα, μη πολύτιμα μέταλλα
Κριτήριο κατάτμησης 2 — υποκείμενο μέταλλο
Κριτήριο κατάτμησης 3 — το ονομαστικό νόμισμα που ορίζεται ως το νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το ονομαστικό ποσό του δικαιώματος προαίρεσης
Κριτήριο κατάτμησης 4 — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του δικαιώματος προαίρεσης ορίζεται ως εξής:</td><td>10 000 000 ευρώ</td><td>10</td></tr>
<tr><td></td><td>Πολύτιμα μέταλλα</td><td>Μη πολύτιμα μέταλλα</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 1: 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες</td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 1: 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 2: 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος</td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 2: 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη</td><td></td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼B

<table>
<tr><td colspan="5">Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού</td><td colspan="3" rowspan="2">Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω</td><td colspan="2">Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας</td></tr>
<tr><td>Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]</td><td>Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]</td></tr>
<tr><td></td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 3: 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη</td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 3: 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη</td><td></td><td rowspan="4"></td><td rowspan="4"></td></tr>
<tr><td></td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 4: 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη</td><td>…</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>…</td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας m: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας m: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>Συμφωνίες ανταλλαγής επί εμπορευμάτων μετάλλων</td><td colspan="3">μια υποκατηγορία συμφωνιών ανταλλαγής επί εμπορευμάτων μετάλλων ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης:
Κριτήριο κατάτμησης 1 — τύπος μετάλλου: πολύτιμα μέταλλα, μη πολύτιμα μέταλλα
Κριτήριο κατάτμησης 2 — υποκείμενο μέταλλο
Κριτήριο κατάτμησης 3 — το ονομαστικό νόμισμα που ορίζεται ως το νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το ονομαστικό ποσό της συμφωνίας ανταλλαγής
Κριτήριο κατάτμησης 4 — ο τύπος διακανονισμού ορίζεται ως μετρητά, φυσική παράδοση ή άλλο
Κριτήριο κατάτμησης 5 — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής:</td><td>10 000 000 ευρώ</td><td>10</td></tr>
<tr><td></td><td>Πολύτιμα μέταλλα</td><td>Μη πολύτιμα μέταλλα</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 1: 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες</td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 1: 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος</td><td></td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων					
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**			**Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας**	
				Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
	Κλιμάκιο ληκτότητας 2: 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος	**Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη			
	Κλιμάκιο ληκτότητας 3: 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη	**Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη			
	Κλιμάκιο ληκτότητας 4: 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη	…			
	…	**Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη			
	Κλιμάκιο ληκτότητας m: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη				
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις επί εμπορευμάτων ενέργειας	μια υποκατηγορία συμβολαίων μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακών συμβάσεων επί εμπορευμάτων ενέργειας ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — τύπος ενέργειας: πετρέλαιο, αποστάγματα πετρελαίου, άνθρακας, ελαφρά κλάσματα πετρελαίου, φυσικό αέριο, ηλεκτρική ενέργεια, διά-ενεργειακά **Κριτήριο κατάτμησης 2** — υποκείμενο στοιχείο ενέργειας **Κριτήριο κατάτμησης 3** — το ονομαστικό νόμισμα που ορίζεται ως το νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το ονομαστικό ποσό του συμβολαίου μελλοντικής εκπλήρωσης/της προθεσμιακής σύμβασης **Κριτήριο κατάτμησης 4** — ο τύπος φορτίου ορίζεται ως βασικό φορτίο, φορτίο αιχμής, φορτίο εκτός αιχμής ή άλλα, που ισχύει για τον τύπο ενέργειας: ηλεκτρική ενέργεια **Κριτήριο κατάτμησης 5** — τόπος παράδοσης/διακανονισμού σε μετρητά που ισχύει για τους τύπους ενέργειας: πετρέλαιο, αποστάγματα πετρελαίου, ελαφρά κλάσματα πετρελαίου, ηλεκτρική ενέργεια, διά-ενεργειακά **Κριτήριο κατάτμησης 6** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του συμβολαίου μελλοντικής εκπλήρωσης/της προθεσμιακής σύμβασης ορίζεται ως εξής:			10 000 000 ευρώ	10

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων					
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**			**Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας**	
				Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
	Πετρέλαιο/αποστάγματα πετρελαίου/ελαφρά κλάσματα πετρελαίου	**Άνθρακας**	**Φυσικό αέριο/ηλεκτρική ενέργεια/διάενεργειακά**		
	Κλιμάκιο ληκτότητας 1: 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 4 μήνες	**Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες	**Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 μήνας		
	Κλιμάκιο ληκτότητας 2: 4 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 8 μήνες	**Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος	**Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 1 μήνας < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος		
	Κλιμάκιο ληκτότητας 3: 8 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος	**Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη	**Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη		
	Κλιμάκιο ληκτότητας 4: 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη	…	…		
	…	**Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	**Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη		
	Κλιμάκιο ληκτότητας m: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη				

▼B

<table>
<tr><td colspan="4">Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού</td><td rowspan="2">Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω</td><td colspan="2">Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας</td></tr>
<tr><td>Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]</td><td>Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]</td></tr>
<tr><td>Δικαιώματα προαίρεσης επί εμπορευμάτων ενέργειας</td><td>μια υποκατηγορία δικαιωμάτων προαίρεσης επί εμπορευμάτων ενέργειας ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης:
Κριτήριο κατάτμησης 1 — τύπος ενέργειας: πετρέλαιο, αποστάγματα πετρελαίου, άνθρακας, ελαφρά κλάσματα πετρελαίου, φυσικό αέριο, ηλεκτρική ενέργεια, διά-ενεργειακά
Κριτήριο κατάτμησης 2 — υποκείμενο στοιχείο ενέργειας
Κριτήριο κατάτμησης 3 — το ονομαστικό νόμισμα που ορίζεται ως το νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το ονομαστικό ποσό του δικαιώματος προαίρεσης
Κριτήριο κατάτμησης 4 — ο τύπος φορτίου ορίζεται ως βασικό φορτίο, φορτίο αιχμής, φορτίο εκτός αιχμής ή άλλα, που ισχύει για τον τύπο ενέργειας: ηλεκτρική ενέργεια
Κριτήριο κατάτμησης 5 — τόπος παράδοσης/διακανονισμού σε μετρητά που ισχύει για τους τύπους ενέργειας: πετρέλαιο, αποστάγματα πετρελαίου, ελαφρά κλάσματα πετρελαίου, ηλεκτρική ενέργεια, διά-ενεργειακά
Κριτήριο κατάτμησης 6 — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του δικαιώματος προαίρεσης ορίζεται ως εξής:
<table>
<tr><th>Πετρέλαιο/αποστάγματα πετρελαίου/ελαφρά κλάσματα πετρελαίου</th><th>Άνθρακας</th><th>Φυσικό αέριο/ηλεκτρική ενέργεια/διά-ενεργειακά</th></tr>
<tr><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 1: 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 4 μήνες</td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 1: 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες</td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 1: 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 μήνας</td></tr>
<tr><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 2: 4 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 8 μήνες</td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 2: 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος</td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 2: 1 μήνας < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος</td></tr>
<tr><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 3: 8 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος</td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 3: 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη</td><td>Κλιμάκιο ληκτότητας 3: 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη</td></tr>
</table></td><td>10 000 000 ευρώ</td><td>10</td></tr>
</table>

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων					
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**			**Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας**	
				Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
	Κλιμάκιο ληκτότητας 4: 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη	…	…		
	…	**Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	**Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη		
	Κλιμάκιο ληκτότητας m: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη				
Συμφωνίες ανταλλαγής επί εμπορευμάτων ενέργειας	μια υποκατηγορία συμφωνιών ανταλλαγής επί εμπορευμάτων ενέργειας ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — τύπος ενέργειας: πετρέλαιο, αποστάγματα πετρελαίου, άνθρακας, ελαφρά κλάσματα πετρελαίου, φυσικό αέριο, ηλεκτρική ενέργεια, διά-ενεργειακά **Κριτήριο κατάτμησης 2** — υποκείμενο στοιχείο ενέργειας **Κριτήριο κατάτμησης 3** — το ονομαστικό νόμισμα που ορίζεται ως το νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το ονομαστικό ποσό της συμφωνίας ανταλλαγής **Κριτήριο κατάτμησης 4** — ο τύπος διακανονισμού ορίζεται ως μετρητά, φυσική παράδοση ή άλλο **Κριτήριο κατάτμησης 5** — ο τύπος φορτίου ορίζεται ως βασικό φορτίο, φορτίο αιχμής, φορτίο εκτός αιχμής ή άλλα, που ισχύει για τον τύπο ενέργειας: ηλεκτρική ενέργεια **Κριτήριο κατάτμησης 6** — τόπος παράδοσης/διακανονισμού σε μετρητά που ισχύει για τους τύπους ενέργειας: πετρέλαιο, αποστάγματα πετρελαίου, ελαφρά κλάσματα πετρελαίου, ηλεκτρική ενέργεια, διά-ενεργειακά **Κριτήριο κατάτμησης 7** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής:			10 000 000 ευρώ	10

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων					
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**			**Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας**	
				Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
	Πετρέλαιο/αποστάγματα πετρελαίου/ελαφρά κλάσματα πετρελαίου	**Άνθρακας**	**Φυσικό αέριο/ηλεκτρική ενέργεια/διάενεργειακά**		
	Κλιμάκιο ληκτότητας 1: 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 4 μήνες	**Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες	**Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 μήνας		
	Κλιμάκιο ληκτότητας 2: 4 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 8 μήνες	**Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος	**Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 1 μήνας < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος		
	Κλιμάκιο ληκτότητας 3: 8 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος	**Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη	**Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη		
	Κλιμάκιο ληκτότητας 4: 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη	…	…		
	…	**Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	**Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη		
	Κλιμάκιο ληκτότητας m: (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη				

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων			
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας**	
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις επί γεωργικών βασικών εμπορευμάτων	μια υποκατηγορία συμβολαίων μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακών συμβάσεων επί γεωργικών βασικών εμπορευμάτων ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενο γεωργικό βασικό εμπόρευμα **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το ονομαστικό νόμισμα που ορίζεται ως το νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το ονομαστικό ποσό του συμβολαίου μελλοντικής εκπλήρωσης/της προθεσμιακής σύμβασης **Κριτήριο κατάτμησης 3** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του συμβολαίου μελλοντικής εκπλήρωσης/της προθεσμιακής σύμβασης ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	10 000 000 ευρώ	10
Δικαιώματα προαίρεσης επί γεωργικών βασικών εμπορευμάτων	μια υποκατηγορία δικαιωμάτων προαίρεσης επί γεωργικών βασικών εμπορευμάτων ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενο γεωργικό βασικό εμπόρευμα **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το ονομαστικό νόμισμα που ορίζεται ως το νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το ονομαστικό ποσό του δικαιώματος προαίρεσης **Κριτήριο κατάτμησης 3** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του δικαιώματος προαίρεσης ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	10 000 000 ευρώ	10

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων			
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας**	
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
Συμφωνίες ανταλλαγής επί γεωργικών βασικών εμπορευμάτων	μια υποκατηγορία συμφωνιών ανταλλαγής επί γεωργικών βασικών εμπορευμάτων ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενο γεωργικό βασικό εμπόρευμα **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το ονομαστικό νόμισμα που ορίζεται ως το νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το ονομαστικό ποσό της συμφωνίας ανταλλαγής **Κριτήριο κατάτμησης 3** — ο τύπος διακανονισμού ορίζεται ως μετρητά, φυσική παράδοση ή άλλο **Κριτήριο κατάτμησης 4** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	10 000 000 ευρώ	10
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εφαρμόζεται η ακόλουθη μεθοδολογία**		
Άλλα παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων			
παράγωγο επί βασικών εμπορευμάτων που δεν ανήκει σε καμία από τις ανωτέρω κατηγορίες επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	οποιοδήποτε άλλο παράγωγο επί βασικών εμπορευμάτων για το οποίο θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά		

▼B

Πίνακας 7.2

Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων														
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**													
	Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων	**Προσυναλλακτικό SSTI**					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**			**Μετασυναλλακτικό LIS**		
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις επί εμπορευμάτων μετάλλων	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	250 000 ευρώ	70	500 000 ευρώ	80	60	750 000 ευρώ	90	70	1 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									
Δικαιώματα προαίρεσης επί εμπορευμάτων μετάλλων	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	250 000 ευρώ	70	500 000 ευρώ	80	60	750 000 ευρώ	90	70	1 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων														
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**													
	Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων	**Προσυναλλακτικό SSTI**					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**			**Μετασυναλλακτικό LIS**		
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Συμφωνίες ανταλλαγής επί εμπορευμάτων μετάλλων	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	250 000 ευρώ	70	500 000 ευρώ	80	60	750 000 ευρώ	90	70	1 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις επί εμπορευμάτων ενέργειας	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	250 000 ευρώ	70	500 000 ευρώ	80	60	750 000 ευρώ	90	70	1 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									
Δικαιώματα προαίρεσης επί εμπορευμάτων ενέργειας	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας	S1	S2	S3	S4	250 000 ευρώ	70	500 000 ευρώ	80	60	750 000 ευρώ	90	70	1 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων														
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**													
	Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων	**Προσυναλλακτικό SSTI**					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**			**Μετασυναλλακτικό LIS**		
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
	υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία													
Συμφωνίες ανταλλαγής επί εμπορευμάτων ενέργειας	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	250 000 ευρώ	70	500 000 ευρώ	80	60	750 000 ευρώ	90	70	1 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις επί γεωργικών βασικών εμπορευμάτων	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	250 000 ευρώ	70	500 000 ευρώ	80	60	750 000 ευρώ	90	70	1 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων															
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**														
	Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων	**Προσυναλλακτικό SSTI**					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**			**Μετασυναλλακτικό LIS**		
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Δικαιώματα προαίρεσης επί γεωργικών βασικών εμπορευμάτων	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	250 000 ευρώ	70	500 000 ευρώ	80	60	750 000 ευρώ	90	70	1 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									
Συμφωνίες ανταλλαγής επί γεωργικών βασικών εμπορευμάτων	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	250 000 ευρώ	70	500 000 ευρώ	80	60	750 000 ευρώ	90	70	1 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									

▼B

Πίνακας 7.3

Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων				
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά**			
	Προσυναλλακτικό SSTI	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
	Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις επί εμπορευμάτων μετάλλων	250 000 ευρώ	500 000 ευρώ	750 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ
Δικαιώματα προαίρεσης επί εμπορευμάτων μετάλλων	250 000 ευρώ	500 000 ευρώ	750 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ
Συμφωνίες ανταλλαγής επί εμπορευμάτων μετάλλων	250 000 ευρώ	500 000 ευρώ	750 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις επί εμπορευμάτων ενέργειας	250 000 ευρώ	500 000 ευρώ	750 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ
Δικαιώματα προαίρεσης επί εμπορευμάτων ενέργειας	250 000 ευρώ	500 000 ευρώ	750 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ
Συμφωνίες ανταλλαγής επί εμπορευμάτων ενέργειας	250 000 ευρώ	500 000 ευρώ	750 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις επί γεωργικών βασικών εμπορευμάτων	250 000 ευρώ	500 000 ευρώ	750 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ
Δικαιώματα προαίρεσης επί γεωργικών βασικών εμπορευμάτων	250 000 ευρώ	500 000 ευρώ	750 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ
Συμφωνίες ανταλλαγής επί γεωργικών βασικών εμπορευμάτων	250 000 ευρώ	500 000 ευρώ	750 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ
Άλλα παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων	250 000 ευρώ	500 000 ευρώ	750 000 ευρώ	1 000 000 ευρώ

▼B

8. **Παράγωγα επί συναλλάγματος**

Πίνακας 8.1

Παράγωγα επί συναλλάγματος — κατηγορίες για τις οποίες δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί συναλλάγματος			
χρηματοπιστωτικό μέσο που αφορά νομίσματα, όπως ορίζεται στο παράρτημα Ι τμήμα Γ 4) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ			
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας**	
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
Μη παραδοτέες προθεσμιακές συμβάσεις (NDF) σημαίνει μια προθεσμιακή σύμβαση που, σύμφωνα με τους όρους της, διακανονίζεται σε μετρητά μεταξύ των αντισυμβαλλομένων της, εφόσον το ποσό διακανονισμού προσδιορίζεται από τη διαφορά της ισοτιμίας των δύο νομισμάτων μεταξύ της ημερομηνίας συναλλαγής και της ημερομηνίας αποτίμησης. Κατά την ημερομηνία διακανονισμού, το ένα μέρος θα οφείλει στο άλλο μέρος την καθαρή διαφορά μεταξύ i) της συναλλαγματικής ισοτιμίας που ορίστηκε κατά την ημερομηνία της συναλλαγής· και ii) της συναλλαγματικής ισοτιμίας κατά την ημερομηνία αποτίμησης, με βάση το ονομαστικό ποσό, με το καθαρό πληρωτέο ποσό στο νόμισμα διακανονισμού που ορίζεται στη σύμβαση.	μια υποκατηγορία μη παραδοτέων προθεσμιακών συμβάσεων επί συναλλάγματος ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — το υποκείμενο ζεύγος νομισμάτων ορίζεται ως ο συνδυασμός των δύο νομισμάτων που διέπουν τη σύμβαση παραγώγων **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της προθεσμιακής σύμβασης ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 εβδομάδα **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 1 εβδομάδα < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	Για τις μη παραδοτέες προθεσμιακές συμβάσεις (NDF) θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά	

▼B

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας	
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
Παραδοτέες προθεσμιακές συμβάσεις (DF) σημαίνει μια προθεσμιακή σύμβαση που περιλαμβάνει μόνον την ανταλλαγή δύο διαφορετικών νομισμάτων σε μια συγκεκριμένη μελλοντική συμβατική ημερομηνία διακανονισμού σε ένα σταθερό επιτόκιο που συμφωνείται κατά την έναρξη της σύμβασης που διέπει την ανταλλαγή.	μια υποκατηγορία παραδοτέων προθεσμιακών συμβάσεων επί συναλλάγματος ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — το υποκείμενο ζεύγος νομισμάτων ορίζεται ως ο συνδυασμός των δύο νομισμάτων που διέπουν τη σύμβαση παραγώγων **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της προθεσμιακής σύμβασης ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 εβδομάδα **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 1 εβδομάδα < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	Για τις παραδοτέες προθεσμιακές συμβάσεις (NDF) θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά	
Μη παραδοτέα δικαιώματα προαίρεσης επί συναλλάγματος (NDO) σημαίνει ένα δικαίωμα προαίρεσης που, σύμφωνα με τους όρους του, διακανονίζεται σε μετρητά μεταξύ των αντισυμβαλλομένων του, εφόσον το ποσό διακανονισμού προσδιορίζεται από τη διαφορά της ισοτιμίας των δύο	μια υποκατηγορία μη παραδοτέων δικαιωμάτων προαίρεσης επί συναλλάγματος ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — το υποκείμενο ζεύγος νομισμάτων ορίζεται ως ο συνδυασμός των δύο νομισμάτων που διέπουν τη σύμβαση παραγώγων **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του δικαιώματος προαίρεσης ορίζεται ως εξής:	Για τα μη παραδοτέα δικαιώματα προαίρεσης επί συναλλάγματος (NDO) θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά	

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας	
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
νομισμάτων μεταξύ της ημερομηνίας συναλλαγής και της ημερομηνίας αποτίμησης. Κατά την ημερομηνία διακανονισμού, το ένα μέρος θα οφείλει στο άλλο μέρος την καθαρή διαφορά μεταξύ i) της συναλλαγματικής ισοτιμίας που ορίστηκε κατά την ημερομηνία της συναλλαγής· και ii) της συναλλαγματικής ισοτιμίας κατά την ημερομηνία αποτίμησης, με βάση το ονομαστικό ποσό, με το καθαρό πληρωτέο ποσό στο νόμισμα διακανονισμού που ορίζεται στη σύμβαση.	**Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 εβδομάδα **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 1 εβδομάδα < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη		
Παραδοτέα δικαιώματα προαίρεσης επί συναλλάγματος (DO) σημαίνει ένα δικαίωμα προαίρεσης που περιλαμβάνει μόνον την ανταλλαγή δύο διαφορετικών νομισμάτων σε μια συγκεκριμένη μελλοντική συμβατική ημερομηνία διακανονισμού σε ένα σταθερό επιτόκιο που συμφωνείται κατά την έναρξη της σύμβασης που διέπει την ανταλλαγή.	μια υποκατηγορία παραδοτέων δικαιωμάτων προαίρεσης επί συναλλάγματος ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — το υποκείμενο ζεύγος νομισμάτων ορίζεται ως ο συνδυασμός των δύο νομισμάτων που διέπουν τη σύμβαση παραγώγων **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του δικαιώματος προαίρεσης ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 εβδομάδα **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 1 εβδομάδα < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος	Για τα παραδοτέα δικαιώματα προαίρεσης επί συναλλάγματος (DO) θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά	

▼B

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας	
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
	Κλιμάκιο ληκτότητας 4: 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη		
Μη παραδοτέες συμφωνίες ανταλλαγής επί συναλλάγματος (NDS) σημαίνει μια συμφωνία ανταλλαγής που, σύμφωνα με τους όρους της, διακανονίζεται σε μετρητά μεταξύ των αντισυμβαλλομένων της, εφόσον το ποσό διακανονισμού προσδιορίζεται από τη διαφορά της ισοτιμίας των δύο νομισμάτων μεταξύ της ημερομηνίας συναλλαγής και της ημερομηνίας αποτίμησης. Κατά την ημερομηνία διακανονισμού, το ένα μέρος θα οφείλει στο άλλο μέρος την καθαρή διαφορά μεταξύ i) της συναλλαγματικής ισοτιμίας που ορίστηκε κατά την ημερομηνία της συναλλαγής· και ii) της συναλλαγματικής ισοτιμίας κατά την ημερομηνία αποτίμησης, με βάση το ονομαστικό ποσό, με το καθαρό πληρωτέο ποσό στο νόμισμα διακανονισμού που ορίζεται στη σύμβαση.	μια υποκατηγορία μη παραδοτέων συμφωνιών ανταλλαγής επί συναλλάγματος ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — το υποκείμενο ζεύγος νομισμάτων ορίζεται ως ο συνδυασμός των δύο νομισμάτων που διέπουν τη σύμβαση παραγώγων **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 εβδομάδα **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 1 εβδομάδα < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	Για τις μη παραδοτέες συμφωνίες ανταλλαγής επί συναλλάγματος (NDS) θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά	

▼B

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας	
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
Παραδοτέες συμφωνίες ανταλλαγής επί συναλλάγματος (DS) σημαίνει μια συμφωνία ανταλλαγής που περιλαμβάνει μόνον την ανταλλαγή δύο διαφορετικών νομισμάτων σε μια συγκεκριμένη μελλοντική συμβατική ημερομηνία διακανονισμού σε ένα σταθερό επιτόκιο που συμφωνείται κατά την έναρξη της σύμβασης που διέπει την ανταλλαγή.	μια υποκατηγορία παραδοτέων συμφωνιών ανταλλαγής επί συναλλάγματος ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — το υποκείμενο ζεύγος νομισμάτων ορίζεται ως ο συνδυασμός των δύο νομισμάτων που διέπουν τη σύμβαση παραγώγων **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας της συμφωνίας ανταλλαγής ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 εβδομάδα **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 1 εβδομάδα < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	Για τις παραδοτέες συμφωνίες ανταλλαγής επί συναλλάγματος (DS) θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά	
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης επί συναλλάγματος	μια υποκατηγορία συμβολαίων μελλοντικής εκπλήρωσης επί συναλλάγματος ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — το υποκείμενο ζεύγος νομισμάτων ορίζεται ως ο συνδυασμός των δύο νομισμάτων που διέπουν τη σύμβαση παραγώγων	Για τα συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης επί συναλλάγματος θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά	

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας	
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
	Κριτήριο κατάτμησης 2 — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του συμβολαίου μελλοντικής εκπλήρωσης ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 εβδομάδα **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 1 εβδομάδα < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη		
Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί συναλλάγματος			
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εφαρμόζεται η ακόλουθη μεθοδολογία**		
Άλλα παράγωγα επί συναλλάγματος παράγωγο επί συναλλάγματος που δεν ανήκει σε καμία από τις ανωτέρω κατηγορίες επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	οποιοδήποτε άλλο παράγωγο επί συναλλάγματος για το οποίο θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά		

▼B

Πίνακας 8.2

Παράγωγα επί συναλλάγματος — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί συναλλάγματος				
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά**			
	Προσυναλλακτικό SSTI	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
	Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
Μη παραδοτέες προθεσμιακές συμβάσεις (NDF)	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	20 000 000 ευρώ	25 000 000 ευρώ
Παραδοτέες προθεσμιακές συμβάσεις (DF)	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	20 000 000 ευρώ	25 000 000 ευρώ
Μη παραδοτέα δικαιώματα προαίρεσης επί συναλλάγματος (NDO)	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	20 000 000 ευρώ	25 000 000 ευρώ
Παραδοτέα δικαιώματα προαίρεσης επί συναλλάγματος (DO)	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	20 000 000 ευρώ	25 000 000 ευρώ
Μη παραδοτέες συμφωνίες ανταλλαγής επί συναλλάγματος (NDS)	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	20 000 000 ευρώ	25 000 000 ευρώ
Παραδοτέες συμφωνίες ανταλλαγής επί συναλλάγματος (DS)	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	20 000 000 ευρώ	25 000 000 ευρώ
Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης επί συναλλάγματος	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	20 000 000 ευρώ	25 000 000 ευρώ
Άλλα παράγωγα επί συναλλάγματος	4 000 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	20 000 000 ευρώ	25 000 000 ευρώ

▼B

9. **Πιστωτικά παράγωγα**

Πίνακας 9.1

Πιστωτικά παράγωγα — κατηγορίες για τις οποίες δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Πιστωτικά παράγωγα				
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας. Για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εφαρμόζεται το πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, ανάλογα με την περίπτωση**		
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]	**Κατάσταση υψηλής ρευστότητας του δείκτη** [Πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας]
Δείκτης συμφωνιών ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης (CDS) μια συμφωνία ανταλλαγής στο πλαίσιο της οποίας η ανταλλαγή ταμειακών ροών συνδέεται με την πιστοληπτική ικανότητα πολλών εκδοτών χρηματοπιστωτικών μέσων που συνιστούν έναν δείκτη και με την εμφάνιση πιστωτικών γεγονότων	μια υποκατηγορία δείκτη συμφωνιών ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενος δείκτης **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το ονομαστικό νόμισμα που ορίζεται ως το νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το ονομαστικό ποσό του παραγώγου **Κριτήριο κατάτμησης 3** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του CDS ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	200 000 000 ευρώ	10	Για τον υποκείμενο δείκτη θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά: 1) καθ' όλη τη διάρκεια της «κατάστασης υψηλής ρευστότητας» 2) για τις πρώτες 30 εργάσιμες ημέρες της «κατάστασης χαμηλής ρευστότητας 1x» δείκτης «υψηλής ρευστότητας»: η κυλιόμενη πιο πρόσφατη έκδοση (σειρά) του δείκτη, που δημιουργήθηκε από την ημερομηνία κατά την οποία ισχύει η σύνθεση του δείκτη και λήγει μία ημέρα πριν από την ημερομηνία κατά την οποία ισχύει η σύνθεση της επόμενης έκδοσης (σειράς) του δείκτη.

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Πιστωτικά παράγωγα				
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας. Για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εφαρμόζεται το πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, ανάλογα με την περίπτωση**		
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]	**Κατάσταση υψηλής ρευστότητας του δείκτη** [Πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας]
				«κατάσταση χαμηλής ρευστότητας 1x»: η έκδοση (σειρά) του δείκτη, ο οποίος είναι ο αμέσως προηγούμενος της τρέχουσας έκδοσης (σειράς) «υψηλής ρευστότητας» σε μια συγκεκριμένη χρονική στιγμή. Μια έκδοση (σειρά) παύει να είναι «υψηλής ρευστότητας» και τίθεται σε κατάσταση «χαμηλής ρευστότητας 1x» όταν δημιουργείται η τελευταία έκδοση (σειρά) του δείκτη.
Συμφωνία ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης (CDS) μεμονωμένου πιστούχου μια συμφωνία ανταλλαγής στο πλαίσιο της οποίας η ανταλλαγή ταμειακών ροών συνδέεται με την πιστοληπτική ικανότητα ενός εκδότη χρηματοπιστωτικών μέσων και με την εμφάνιση πιστωτικών γεγονότων	μια υποκατηγορία συμφωνιών ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης μεμονωμένου πιστούχου ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — υποκείμενη οντότητα αναφοράς **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το είδος της υποκείμενης οντότητας αναφοράς ορίζεται ως εξής: Ως «εκδότης κρατικού και δημόσιου τύπου» νοείται μια οντότητα εκδότη, η οποία είναι: α) η Ένωση· β) κράτος μέλος, συμπεριλαμβανομένου οποιουδήποτε κυβερνητικού φορέα ή οργανισμού ή φορέα ειδικού σκοπού του κράτους μέλους· γ) κρατικός φορέας που δεν περιλαμβάνεται στα στοιχεία α) και β)·	10 000 000 ευρώ	10	

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Πιστωτικά παράγωγα				
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας. Για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εφαρμόζεται το πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, ανάλογα με την περίπτωση**		
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]	**Κατάσταση υψηλής ρευστότητας του δείκτη** [Πρόσθετο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας]
	δ) σε περίπτωση ομοσπονδιακού κράτους μέλους, ένα από τα μέλη που συγκροτούν την ομοσπονδία· ε) φορέας ειδικού σκοπού για διάφορα κράτη μέλη· στ) διεθνές χρηματοπιστωτικό ίδρυμα που έχει συσταθεί από δύο ή περισσότερα κράτη μέλη, σκοπός του οποίου είναι η κινητοποίηση χρηματοδότησης και η παροχή χρηματοοικονομικής βοήθειας προς όφελος των μελών του, τα οποία αντιμετωπίζουν ή απειλούνται με σοβαρά προβλήματα χρηματοδότησης· ζ) η Ευρωπαϊκή Τράπεζα Επενδύσεων· η) οντότητα του Δημοσίου που δεν είναι εκδότης κρατικής ομολογίας, όπως ορίζεται στα στοιχεία α) έως γ). Ως «εκδότης εταιρικού τύπου» νοείται μια οντότητα εκδότη που δεν είναι κρατικού και δημόσιου τύπου. **Κριτήριο κατάτμησης 3** — το ονομαστικό νόμισμα που ορίζεται ως το νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το ονομαστικό ποσό του παραγώγου **Κριτήριο κατάτμησης 4** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του CDS ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη			

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Πιστωτικά παράγωγα		
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί το ακόλουθο ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας**
Δικαιώματα προαίρεσης με βάση δείκτη CDS δικαίωμα προαίρεσης του οποίου το υποκείμενο στοιχείο είναι ένας δείκτης CDS	μια υποκατηγορία δικαιωμάτων προαίρεσης με βάση δείκτη CDS ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — η υποκατηγορία δεικτών CDS, όπως ορίζεται για την κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού δεικτών συμφωνιών ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης (CDS) **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του δικαιώματος προαίρεσης ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	για ένα δικαίωμα προαίρεσης με βάση δείκτη CDS, του οποίου ο υποκείμενος δείκτης CDS είναι μια υποκατηγορία για την οποία έχει καθοριστεί ότι υπάρχει ρευστή αγορά και της οποίας το κλιμάκιο ληκτότητας είναι 0-6 μήνες, θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά για ένα δικαίωμα προαίρεσης με βάση δείκτη CDS, του οποίου ο υποκείμενος δείκτης CDS είναι μια υποκατηγορία για την οποία έχει καθοριστεί ότι υπάρχει ρευστή αγορά και της οποίας το κλιμάκιο ληκτότητας δεν είναι 0-6 μήνες, θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά για ένα δικαίωμα προαίρεσης με βάση δείκτη CDS, του οποίου ο υποκείμενος δείκτης CDS είναι μια υποκατηγορία για την οποία έχει καθοριστεί ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά για οποιαδήποτε δεδομένη στιγμή του κλιμακίου ληκτότητας
Δικαιώματα προαίρεσης CDS μεμονωμένου πιστούχου δικαίωμα προαίρεσης του οποίου το υποκείμενο στοιχείο είναι CDS μεμονωμένου πιστούχου	μια υποκατηγορία δικαιωμάτων προαίρεσης CDS μεμονωμένου πιστούχου ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — η υποκατηγορία CDS μεμονωμένου πιστούχου, όπως ορίζεται για την κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού των CDS μεμονωμένου πιστούχου **Κριτήριο κατάτμησης 2** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του δικαιώματος προαίρεσης ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη	για ένα δικαίωμα προαίρεσης CDS μεμονωμένου πιστούχου, του οποίου το υποκείμενο CDS μεμονωμένου πιστούχου είναι μια υποκατηγορία για την οποία έχει καθοριστεί ότι υπάρχει ρευστή αγορά και της οποίας το κλιμάκιο ληκτότητας είναι 0-6 μήνες, θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά για ένα δικαίωμα προαίρεσης CDS μεμονωμένου πιστούχου, του οποίου το υποκείμενο CDS μεμονωμένου πιστούχου είναι μια υποκατηγορία για την οποία έχει καθοριστεί ότι υπάρχει ρευστή αγορά και της οποίας το κλιμάκιο ληκτότητας δεν είναι 0-6 μήνες, θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά για ένα δικαίωμα προαίρεσης CDS μεμονωμένου πιστούχου, του οποίου το υποκείμενο CDS μεμονωμένου πιστούχου είναι μια υποκατηγορία για την οποία έχει καθοριστεί ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά για οποιαδήποτε δεδομένη στιγμή του κλιμακίου ληκτότητας

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Πιστωτικά παράγωγα	
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εφαρμόζεται η ακόλουθη μεθοδολογία**
Άλλα πιστωτικά παράγωγα	
πιστωτικό παράγωγο που δεν ανήκει σε καμία από τις ανωτέρω κατηγορίες επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	οποιαδήποτε άλλα πιστωτικά παράγωγα για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Πίνακας 9.2

Πιστωτικά παράγωγα — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Πιστωτικά παράγωγα														
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**													
	Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων	**Προσυναλλακτικό SSTI**					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**			**Μετασυναλλακτικό LIS**		
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Δείκτης συμφωνιών ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης (CDS)	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	2 500 000 ευρώ	70	5 000 000 ευρώ	80	60	7 500 000 ευρώ	90	70	10 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Πιστωτικά παράγωγα														
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**													
	Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων	**Προσυναλλακτικό SSTI**					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**			**Μετασυναλλακτικό LIS**		
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Συμφωνία ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης (CDS) μεμονωμένου πιστούχου	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	2 500 000 ευρώ	70	5 000 000 ευρώ	80	60	7 500 000 ευρώ	90	70	10 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									
Συμφωνία ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης (CDS) ειδικού τύπου καλαθιού	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	2 500 000 ευρώ	70	5 000 000 ευρώ	80	60	7 500 000 ευρώ	90	70	10 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Πιστωτικά παράγωγα															
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**														
	Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων	**Προσυναλλακτικό SSTI**					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**			**Μετασυναλλακτικό LIS**		
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Δικαιώματα προαίρεσης με βάση δείκτη CDS	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	2 500 000 ευρώ	70	5 000 000 ευρώ	80	60	7 500 000 ευρώ	90	70	10 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									
Δικαιώματα προαίρεσης CDS μεμονωμένου πιστούχου	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	2 500 000 ευρώ	70	5 000 000 ευρώ	80	60	7 500 000 ευρώ	90	70	10 000 000 ευρώ
		30	40	50	60									

▼B

Πίνακας 9.3

Πιστωτικά παράγωγα — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Πιστωτικά παράγωγα				
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά**			
	Προσυναλλακτικό SSTI	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
	Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
Δείκτης συμφωνιών ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης (CDS)	2 500 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	7 500 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ
Συμφωνία ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης (CDS) μεμονωμένου πιστούχου	2 500 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	7 500 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ
Συμφωνία ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης (CDS) ειδικού τύπου καλαθιού	2 500 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	7 500 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ
Δικαιώματα προαίρεσης με βάση δείκτη CDS	2 500 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	7 500 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ
Δικαιώματα προαίρεσης CDS μεμονωμένου πιστούχου	2 500 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	7 500 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ
Άλλα πιστωτικά παράγωγα	2 500 000 ευρώ	5 000 000 ευρώ	7 500 000 ευρώ	10 000 000 ευρώ

▼B

10. **Παράγωγα C10**

Πίνακας 10.1

Παράγωγα C10 — κατηγορίες για τις οποίες δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — παράγωγα C10			
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας**	
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
Ναυτιλιακά παράγωγα χρηματοπιστωτικό μέσο που αφορά τις τιμές των ναύλων, όπως ορίζεται στο παράρτημα Ι τμήμα Γ 10) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ	μια υποκατηγορία ναυτιλιακών παραγώγων ορίζεται από τα ακόλουθα κριτήρια κατάτμησης: **Κριτήριο κατάτμησης 1** — τύπος σύμβασης: Συμφωνίες προθεσμιακής αγοράς ναύλων (FFA) ή δικαιώματα προαίρεσης **Κριτήριο κατάτμησης 2** — τύπος φορτίου: υγρό φορτίο, ξηρό φορτίο **Κριτήριο κατάτμησης 3** — επιμέρους τύπος φορτίου: πλοία μεταφοράς ξηρού φορτίου χύδην, δεξαμενόπλοια, πλοία μεταφοράς εμπορευματοκιβωτίων **Κριτήριο κατάτμησης 4** — προσδιορισμός του μεγέθους που σχετίζεται με τον επιμέρους τύπο φορτίου **Κριτήριο κατάτμησης 5** — ειδική διαδρομή ή μέση χρονοναύλωση **Κριτήριο κατάτμησης 6** — το κλιμάκιο υπολειπόμενης ληκτότητας του παραγώγου ορίζεται ως εξής: **Κλιμάκιο ληκτότητας 1:** 0 < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 μήνας **Κλιμάκιο ληκτότητας 2:** 1 μήνας < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 3:** 3 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 6 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 4:** 6 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 9 μήνες **Κλιμάκιο ληκτότητας 5:** 9 μήνες < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 1 έτος	10 000 000 ευρώ	10

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — παράγωγα C10			
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας**	
		Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
	Κλιμάκιο ληκτότητας 6: 1 έτος < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 2 έτη **Κλιμάκιο ληκτότητας 7:** 2 έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ 3 έτη … **Κλιμάκιο ληκτότητας m:** (n-1) έτη < υπολειπόμενη ληκτότητα ≤ n έτη		

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — παράγωγα C10	
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εφαρμόζεται η ακόλουθη μεθοδολογία**
Άλλα παράγωγα C10 χρηματοπιστωτικό μέσο, όπως ορίζεται στο παράρτημα Ι τμήμα Γ 10) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ, το οποίο δεν αποτελεί «ναυτιλιακό παράγωγο», οποιαδήποτε από τις ακόλουθες κατηγορίες επιμέρους στοιχείων ενεργητικού παραγώγων επί επιτοκίων: συμφωνία ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού σε πολλά νομίσματα (multi-currency swap) ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής (cross-currency swap), συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση σε συμφωνίες ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού σε πολλά νομίσματα (multi-currency swaps) ή σε διασυναλλαγματικές συμφωνίες ανταλλαγής (cross-currency swaps), συμφωνία ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού στο ίδιο νόμισμα (single-currency swap), συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση σε συμφωνία ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού στο ίδιο νόμισμα (single-currency swap) και οποιαδήποτε από τις ακόλουθες κατηγορίες επιμέρους στοιχείων ενεργητικού παραγώγων επί μετοχών: «δικαίωμα προαίρεσης βάσει δείκτη μεταβλητότητας», «συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση βάσει δείκτη μεταβλητότητας», συμφωνία ανταλλαγής με παράμετρο διακύμανσης της απόδοσης, συμφωνία ανταλλαγής με παράμετρο μεταβλητότητας της απόδοσης, συμφωνία ανταλλαγής χαρτοφυλακίου με παράμετρο διακύμανσης της απόδοσης, συμφωνία ανταλλαγής χαρτοφυλακίου με παράμετρο μεταβλητότητας της απόδοσης	οποιαδήποτε άλλα παράγωγα C10 για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά

▼B

Πίνακας 10.2

Παράγωγα C10 — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — παράγωγα C10														
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**													
	Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων	**Προσυναλλακτικό SSTI**					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**			**Μετασυναλλακτικό LIS**		
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Ναυτιλιακά παράγωγα	ο υπολογισμός των ορίων θα πρέπει να γίνεται για κάθε υποκατηγορία της κατηγορίας επιμέρους στοιχείων ενεργητικού, λαμβάνοντας υπόψη τις συναλλαγές που εκτελούνται σε χρηματοπιστωτικά μέσα που ανήκουν στην υποκατηγορία	S1	S2	S3	S4	25 000 ευρώ	70	50 000 ευρώ	80	60	75 000 ευρώ	90	70	100 000 ευρώ
		30	40	50	60									

Πίνακας 10.3

Παράγωγα C10 — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — παράγωγα C10				
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά**			
	Προσυναλλακτικό SSTI	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
	Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
Ναυτιλιακά παράγωγα	25 000 ευρώ	50 000 ευρώ	75 000 ευρώ	100 000 ευρώ
Άλλα παράγωγα C10	25 000 ευρώ	50 000 ευρώ	75 000 ευρώ	100 000 ευρώ

▼B

11. **Χρηματοοικονομικές συμβάσεις επί διαφοράς (CFD)**

Πίνακας 11.1

CFD — κατηγορίες για τις οποίες δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Χρηματοοικονομικές συμβάσεις επί διαφοράς (CFD)				
σύμβαση παραγώγων που παρέχει στον κάτοχο έκθεση, η οποία μπορεί να είναι θετική ή αρνητική, στη διαφορά μεταξύ της τιμής ενός υποκείμενου στοιχείου ενεργητικού κατά την έναρξη της σύμβασης και της τιμής όταν η σύμβαση λήξει				
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω**	**Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας ή, κατά περίπτωση, εάν δεν πληροί το ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, όπως ορίζεται κατωτέρω**		
		Ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας	**Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA)** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
Συμβάσεις επί διαφοράς (CFD) νομισμάτων	μια υποκατηγορία συμβάσεων CFD νομισμάτων ορίζεται από το υποκείμενο ζεύγος νομισμάτων που ορίζεται ως συνδυασμός των δύο υποκείμενων νομισμάτων της σύμβασης CFD/τοποθέτησης επί διαφοράς (spread betting)		50 000 000 ευρώ	100
Συμβάσεις επί διαφοράς (CFD) βασικών εμπορευμάτων	μια υποκατηγορία συμβάσεων CFD βασικών εμπορευμάτων ορίζεται από το υποκείμενο βασικό εμπόρευμα της σύμβασης CFD/τοποθέτησης επί διαφοράς (spread betting)		50 000 000 ευρώ	100
Συμβάσεις επί διαφοράς (CFD) μετοχών	μια υποκατηγορία συμβάσεων CFD μετοχών ορίζεται από τον υποκείμενο μετοχικό τίτλο της σύμβασης CFD/τοποθέτησης επί διαφοράς (spread betting)	για μια υποκατηγορία συμβάσεων CFD μετοχών θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εάν το υποκείμενο στοιχείο είναι μετοχικός τίτλος για τον οποίο υπάρχει ρευστή αγορά, όπως καθορίζεται σύμφωνα με το άρθρο 2 παράγραφος 1 σημείο 17) στοιχείο β) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014		
Συμβάσεις επί διαφοράς (CFD) ομολογιών	μια υποκατηγορία συμβάσεων CFD ομολογιών ορίζεται από την υποκείμενη ομολογία ή το συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης επί ομολογιών της σύμβασης CFD/τοποθέτησης επί διαφοράς (spread betting)	για μια υποκατηγορία συμβάσεων CFD ομολογιών θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εάν το υποκείμενο στοιχείο είναι ομολογία ή συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης επί ομολογιών για το οποίο υπάρχει ρευστή αγορά, όπως καθορίζεται σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β).		

▼B

Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού υποδιαιρείται περαιτέρω σε υποκατηγορίες όπως ορίζονται κατωτέρω	Για κάθε υποκατηγορία καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας ή, κατά περίπτωση, εάν δεν πληροί το ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας, όπως ορίζεται κατωτέρω		
		Ποιοτικό κριτήριο ρευστότητας	**Μέσο ημερήσιο ονομαστικό ποσό (ADNA)** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
Συμβάσεις CFD επί συμβολαίου μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακής σύμβασης μετοχών	μια σύμβαση CFD για μια υποκατηγορία συμβολαίων μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακών συμβάσεων μετοχών ορίζεται από το υποκείμενο συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση επί μιας μετοχής της σύμβασης CFD/τοποθέτησης επί διαφοράς (spread betting)	για μια σύμβαση CFD για μια υποκατηγορία συμβολαίων μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακών συμβάσεων μετοχών θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εάν ο υποκείμενος τίτλος είναι συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακή σύμβαση για τα οποία υπάρχει ρευστή αγορά, όπως καθορίζεται σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β).		
Συμβάσεις CFD επί δικαιώματος προαίρεσης επί μετοχής	μια σύμβαση CFD για μια υποκατηγορία δικαιωμάτων προαίρεσης επί μετοχής ορίζεται από το υποκείμενο δικαίωμα προαίρεσης επί μιας μετοχής της σύμβασης CFD/τοποθέτησης επί διαφοράς (spread betting)	για μια σύμβαση CFD για ένα δικαίωμα προαίρεσης επί μετοχής θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, εάν ο υποκείμενος τίτλος είναι δικαίωμα προαίρεσης επί μετοχής για το οποίο υπάρχει ρευστή αγορά, όπως καθορίζεται σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β).		

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Χρηματοοικονομικές συμβάσεις επί διαφοράς (CFD)	
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εφαρμόζεται η ακόλουθη μεθοδολογία**
Άλλες συμβάσεις CFD	
μια σύμβαση CFD/ τοποθέτησης επί διαφοράς (spread betting) που δεν ανήκει σε καμία από τις ανωτέρω κατηγορίες επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	οποιαδήποτε άλλη σύμβαση CFD/τοποθέτησης επί διαφοράς (spread betting) για την οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά

▼B

Πίνακας 11.2

Συμβάσεις CFD — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Χρηματοοικονομικές συμβάσεις επί διαφοράς (CFD)														
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**													
	Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων	**Προσυναλλακτικό SSTI**					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**			**Μετασυναλλακτικό LIS**		
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Συμβάσεις επί διαφοράς (CFD) νομισμάτων	συναλλαγές που εκτελούνται σε συμβάσεις CFD νομισμάτων για τις οποίες θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β)	S1	S2	S3	S4	50 000 ευρώ	70	60 000 ευρώ	80	60	90 000 ευρώ	90	70	100 000 ευρώ
		30	40	50	60									
Συμβάσεις επί διαφοράς (CFD) βασικών εμπορευμάτων	συναλλαγές που εκτελούνται σε συμβάσεις CFD βασικών εμπορευμάτων για τις οποίες θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β)	S1	S2	S3	S4	50 000 ευρώ	70	60 000 ευρώ	80	60	90 000 ευρώ	90	70	100 000 ευρώ
		30	40	50	60									
Συμβάσεις επί διαφοράς (CFD) μετοχών	συναλλαγές που εκτελούνται σε συμβάσεις CFD μετοχών για τις οποίες θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β)	S1	S2	S3	S4	50 000 ευρώ	70	60 000 ευρώ	80	60	90 000 ευρώ	90	70	100 000 ευρώ
		30	40	50	60									

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Χρηματοοικονομικές συμβάσεις επί διαφοράς (CFD)															
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**														
	Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τους υπολογισμούς των ορίων	**Προσυναλλακτικό SSTI**					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**			**Μετασυναλλακτικό LIS**		
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Όγκος — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Συμβάσεις επί διαφοράς (CFD) ομολογιών	συναλλαγές που εκτελούνται σε συμβάσεις CFD ομολογιών για τις οποίες θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β)	S1	S2	S3	S4	50 000 ευρώ	70	60 000 ευρώ	80	60	90 000 ευρώ	90	70	100 000 ευρώ
		30	40	50	60									
Συμβάσεις CFD επί συμβολαίου μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακής σύμβασης μετοχών	συναλλαγές που εκτελούνται σε συμβάσεις CFD επί συμβολαίου μελλοντικής εκπλήρωσης μετοχών για τις οποίες θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β)	S1	S2	S3	S4	50 000 ευρώ	70	60 000 ευρώ	80	60	90 000 ευρώ	90	70	100 000 ευρώ
		30	40	50	60									
Συμβάσεις CFD επί δικαιώματος προαίρεσης επί μετοχής	συναλλαγές που εκτελούνται σε συμβάσεις CFD επί δικαιώματος προαίρεσης επί μετοχής για τις οποίες θεωρείται ότι υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β)	S1	S2	S3	S4	50 000 ευρώ	70	60 000 ευρώ	80	60	90 000 ευρώ	90	70	100 000 ευρώ
		30	40	50	60									

▼B

Πίνακας 11.3

Συμβάσεις CFD — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Χρηματοοικονομικές συμβάσεις επί διαφοράς (CFD)				
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά**			
	Προσυναλλακτικό SSTI	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
	Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
Συμβάσεις επί διαφοράς (CFD) νομισμάτων	50 000 ευρώ	60 000 ευρώ	90 000 ευρώ	100 000 ευρώ
Συμβάσεις επί διαφοράς (CFD) βασικών εμπορευμάτων	50 000 ευρώ	60 000 ευρώ	90 000 ευρώ	100 000 ευρώ
Συμβάσεις επί διαφοράς (CFD) μετοχών	50 000 ευρώ	60 000 ευρώ	90 000 ευρώ	100 000 ευρώ
Συμβάσεις επί διαφοράς (CFD) ομολογιών	50 000 ευρώ	60 000 ευρώ	90 000 ευρώ	100 000 ευρώ
Συμβάσεις CFD επί συμβολαίου μελλοντικής εκπλήρωσης/ προθεσμιακής σύμβασης μετοχών	50 000 ευρώ	60 000 ευρώ	90 000 ευρώ	100 000 ευρώ
Συμβάσεις CFD επί δικαιώματος προαίρεσης επί μετοχής	50 000 ευρώ	60 000 ευρώ	90 000 ευρώ	100 000 ευρώ
Άλλες CFD/τοποθετήσεις επί διαφοράς (spread betting)	50 000 ευρώ	60 000 ευρώ	90 000 ευρώ	100 000 ευρώ

▼B

12. **Δικαιώματα εκπομπής**

Πίνακας 12.1

Δικαιώματα εκπομπής — κατηγορίες για τις οποίες δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Δικαιώματα εκπομπής		
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας.**	
	Μέση ημερήσια ποσότητα (ADA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
Δικαιώματα εκπομπής της Ευρωπαϊκής Ένωσης (EUA) οποιαδήποτε μονάδα η οποία έχει αναγνωριστεί ότι συμμορφώνεται με τις απαιτήσεις της οδηγίας 2003/87/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου [1] (σύστημα εμπορίας δικαιωμάτων εκπομπών) που αντιπροσωπεύει το δικαίωμα εκπομπής του ισοδύναμου ενός τόνου διοξειδίου του άνθρακα (tCO_2e)	150 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	5
Δικαιώματα εκπομπής ΕΕ του κλάδου των αερομεταφορών (EUAA) οποιαδήποτε μονάδα η οποία έχει αναγνωριστεί ότι συμμορφώνεται με τις απαιτήσεις της οδηγίας 2003/87/ΕΚ (σύστημα εμπορίας δικαιωμάτων εκπομπών) που αντιπροσωπεύει το δικαίωμα εκπομπής του ισοδύναμου ενός τόνου διοξειδίου του άνθρακα (tCO_2e) στον κλάδο των αερομεταφορών	150 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	5
Πιστοποιημένες μειώσεις εκπομπών (CER) οποιαδήποτε μονάδα η οποία έχει αναγνωριστεί ότι συμμορφώνεται με τις απαιτήσεις της οδηγίας 2003/87/ΕΚ (σύστημα εμπορίας δικαιωμάτων εκπομπών) που αντιπροσωπεύει το ισοδύναμο των μειώσεων εκπομπών ενός τόνου διοξειδίου του άνθρακα (tCO_2e)	150 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	5
Μονάδες μείωσης των εκπομπών (ERU) οποιαδήποτε μονάδα η οποία έχει αναγνωριστεί ότι συμμορφώνεται με τις απαιτήσεις της οδηγίας 2003/87/ΕΚ (σύστημα εμπορίας δικαιωμάτων εκπομπών) που αντιπροσωπεύει το ισοδύναμο των μειώσεων εκπομπών ενός τόνου διοξειδίου του άνθρακα (tCO_2e)	150 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	5

[1] Οδηγία 2003/87/ΕΚ του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου της 13ης Οκτωβρίου 2003 σχετικά με τη θέσπιση συστήματος εμπορίας δικαιωμάτων εκπομπής αερίων θερμοκηπίου εντός της Κοινότητας και την τροποποίηση της οδηγίας 96/61/ΕΚ του Συμβουλίου (ΕΕ L 275 της 25.10.2003, σ. 32).

▼B

Πίνακας 12.2

Δικαιώματα εκπομπής — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για κατηγορίες επιμέρους στοιχείων ενεργητικού για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Δικαιώματα εκπομπής													
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τον υπολογισμό των ορίων**	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για κατηγορίες επιμέρους στοιχείων ενεργητικού για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**											
		Προσυναλλακτικό SSTI					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**		**Μετασυναλλακτικό LIS**	
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Δικαιώματα εκπομπής της Ευρωπαϊκής Ένωσης (EUA)	συναλλαγές που εκτελούνται σε όλα τα δικαιώματα εκπομπής της Ευρωπαϊκής Ένωσης (EUA)	S1	S2	S3	S4	40 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	70	50 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	80	90 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	90	100 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα
		30	40	50	60							
Δικαιώματα εκπομπής ΕΕ του κλάδου των αερομεταφορών (EUAA)	συναλλαγές που εκτελούνται σε όλα τα δικαιώματα εκπομπής του κλάδου των αερομεταφορών (EUAA)	S1	S2	S3	S4	20 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	70	25 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	80	40 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	90	50 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα
		30	40	50	60							
Πιστοποιημένες μειώσεις εκπομπών (CER)	συναλλαγές που εκτελούνται σε όλες τις πιστοποιημένες μειώσεις των εκπομπών (CER)	S1	S2	S3	S4	20 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	70	25 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	80	40 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	90	50 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα
		30	40	50	60							
Μονάδες μείωσης των εκπομπών (ERU)	συναλλαγές που εκτελούνται σε όλες τις μονάδες μείωσης των εκπομπών (ERU)	S1	S2	S3	S4	20 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	70	25 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	80	40 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	90	50 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα
		30	40	50	60							

Πίνακας 12.3

Δικαιώματα εκπομπής — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για κατηγορίες επιμέρους στοιχείων ενεργητικού για τις οποίες καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Δικαιώματα εκπομπής				
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για υποκατηγορίες για τις οποίες καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά**			
	Προσυναλλακτικό SSTI	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
	Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
Δικαιώματα εκπομπής της Ευρωπαϊκής Ένωσης (EUA)	40 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	50 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	90 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	100 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα
Δικαιώματα εκπομπής ΕΕ του κλάδου των αερομεταφορών (EUAA)	20 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	25 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	40 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	50 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα
Πιστοποιημένες μειώσεις εκπομπών (CER)	20 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	25 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	40 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	50 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα
Μονάδες μείωσης των εκπομπών (ERU)	20 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	25 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	40 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	50 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα

13. **Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής**

Πίνακας 13.1

Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής — κατηγορίες για τις οποίες δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής		
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας.**	
	Μέση ημερήσια ποσότητα (ADA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι του τύπου δικαιώματα εκπομπής της Ευρωπαϊκής Ένωσης (EUA) χρηματοπιστωτικό μέσο που αφορά δικαιώματα εκπομπής του τύπου δικαιώματα εκπομπής της Ευρωπαϊκής Ένωσης (EUA), όπως ορίζεται στο παράρτημα Ι τμήμα Γ 4) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ	150 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	5

▼B

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής		
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για κάθε κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εάν δεν πληροί ένα ή όλα από τα ακόλουθα όρια των ποσοτικών κριτηρίων ρευστότητας.**	
	Μέση ημερήσια ποσότητα (ADA) [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 1]	**Μέσος ημερήσιος αριθμός συναλλαγών** [ποσοτικό κριτήριο ρευστότητας 2]
Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι του τύπου δικαιώματα εκπομπής ΕΕ του κλάδου των αερομεταφορών (EUAA) χρηματοπιστωτικό μέσο που αφορά δικαιώματα εκπομπής του τύπου δικαιώματα εκπομπής του κλάδου των αερομεταφορών (EUAA), όπως ορίζεται στο παράρτημα Ι τμήμα Γ 4) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ	150 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	5
Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι του τύπου πιστοποιημένες μειώσεις εκπομπών (CER) χρηματοπιστωτικό μέσο που αφορά δικαιώματα εκπομπής του τύπου πιστοποιημένες μειώσεις εκπομπών (CER), όπως ορίζεται στο παράρτημα Ι τμήμα Γ 4) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ	150 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	5
Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι του τύπου μονάδες μείωσης των εκπομπών (ERU) χρηματοπιστωτικό μέσο που αφορά δικαιώματα εκπομπής του τύπου μονάδες μείωσης των εκπομπών (ERU), όπως ορίζεται στο παράρτημα Ι τμήμα Γ 4) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ	150 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	5

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής	
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Για τον προσδιορισμό των κατηγοριών χρηματοπιστωτικών μέσων για τα οποία θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά, σύμφωνα με το άρθρο 6 και το άρθρο 8 παράγραφος 1 στοιχείο β), εφαρμόζεται η ακόλουθη μεθοδολογία**
Άλλα παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής παράγωγο επί δικαιωμάτων εκπομπής του οποίου το υποκείμενο στοιχείο δεν είναι δικαιώματα εκπομπής της Ευρωπαϊκής Ένωσης (ΕΕΑ), δικαιώματα εκπομπής ΕΕ του κλάδου των αερομεταφορών (EUAA), πιστοποιημένες μειώσεις εκπομπών (CER) και μονάδες μείωσης των εκπομπών (ERU)	οποιοδήποτε άλλο παράγωγο επί δικαιωμάτων εκπομπής για το οποίο θεωρείται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά

▼B

Πίνακας 13.2

Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για κατηγορίες επιμέρους στοιχείων ενεργητικού για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής													
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Συναλλαγές που πρέπει να λαμβάνονται υπόψη για τον υπολογισμό των ορίων**	**Εκατοστημόρια και κατώτατα όρια που πρέπει να εφαρμόζονται για τον υπολογισμό των προσυναλλακτικών και μετασυναλλακτικών ορίων SSTI και LIS για κατηγορίες επιμέρους στοιχείων ενεργητικού για τις οποίες καθορίζεται ότι υπάρχει ρευστή αγορά**											
		Προσυναλλακτικό SSTI					**Προσυναλλακτικό LIS**		**Μετασυναλλακτικό SSTI**		**Μετασυναλλακτικό LIS**	
		Συναλλαγή — εκατοστημόριο				**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**	**Συναλλαγή — εκατοστημόριο**	**Κατώτατο όριο**
Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι του τύπου δικαιώματα εκπομπής της Ευρωπαϊκής Ένωσης (EUA)	συναλλαγές που εκτελούνται σε όλα τα παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι του τύπου δικαιώματα εκπομπής της Ευρωπαϊκής Ένωσης (EUA)	S1	S2	S3	S4	40 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	70	50 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	80	90 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	90	100 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα
		30	40	50	60							
Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι του τύπου δικαιώματα εκπομπής ΕΕ του κλάδου των αερομεταφορών (EUAA)	συναλλαγές που εκτελούνται σε όλα τα παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι του τύπου δικαιώματα εκπομπής του κλάδου των αερομεταφορών (EUAA)	S1	S2	S3	S4	20 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	70	25 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	80	40 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	90	50 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα
		30	40	50	60							
Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι του τύπου πιστοποιημένες μειώσεις εκπομπών (CER)	συναλλαγές που εκτελούνται σε παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι του τύπου πιστοποιημένες μειώσεις εκπομπών (CER)	S1	S2	S3	S4	20 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	70	25 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	80	40 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	90	50 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα
		30	40	50	60							
Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι του τύπου μονάδες μείωσης των εκπομπών (ERU)	συναλλαγές που εκτελούνται σε παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι του τύπου μονάδες μείωσης των εκπομπών (ERU)	S1	S2	S3	S4	20 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	70	25 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	80	40 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	90	50 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα
		30	40	50	60							

▼B

Πίνακας 13.3

Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής — προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για κατηγορίες επιμέρους στοιχείων ενεργητικού για τις οποίες καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά

Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού — Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής				
Κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού	**Προσυναλλακτικά και μετασυναλλακτικά όρια SSTI και LIS για κατηγορίες επιμέρους στοιχείων ενεργητικού για τις οποίες καθορίζεται ότι δεν υπάρχει ρευστή αγορά**			
	Προσυναλλακτικό SSTI	**Προσυναλλακτικό LIS**	**Μετασυναλλακτικό SSTI**	**Μετασυναλλακτικό LIS**
	Τιμή ορίου	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**	**Τιμή ορίου**
Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι του τύπου δικαιώματα εκπομπής της Ευρωπαϊκής Ένωσης (EUA)	40 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	50 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	90 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	100 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα
Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι του τύπου δικαιώματα εκπομπής ΕΕ του κλάδου των αερομεταφορών (EUAA)	20 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	25 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	40 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	50 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα
Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι του τύπου πιστοποιημένες μειώσεις εκπομπών (CER)	20 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	25 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	40 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	50 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα
Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής των οποίων το υποκείμενο στοιχείο είναι του τύπου μονάδες μείωσης των εκπομπών (ERU)	20 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	25 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	40 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	50 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα
Άλλα παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής	20 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	25 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	40 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα	50 000 τόνοι ισοδυνάμου διοξειδίου του άνθρακα

▼B

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ IV

Δεδομένα αναφοράς που πρέπει να παρέχονται για τους σκοπούς των υπολογισμών διαφάνειας

Πίνακας 1

Πίνακας συμβόλων για τον πίνακα 2

ΣΥΜΒΟΛΟ	ΤΥΠΟΣ ΔΕΔΟΜΕΝΩΝ	ΟΡΙΣΜΟΣ
{ALPHANUM-n}	Έως n αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Πεδίο με ελεύθερο κείμενο.
{DECIMAL-n/m}	Δεκαδικός αριθμός με το πολύ n ψηφία συνολικά, εκ των οποίων το πολύ m ψηφία μπορεί να είναι κλασματικά ψηφία.	Αριθμητικό πεδίο τόσο για θετικές όσο και για αρνητικές τιμές: — σημείο υποδιαστολής:«.» (τελεία)· — ο αριθμός μπορεί να συνοδεύεται από πρόθημα «-» (μείον), το οποίο υποδηλώνει αρνητικό αριθμό. Κατά περίπτωση, οι τιμές στρογγυλεύονται χωρίς αποκοπή.
{COUNTRYCODE_2}	2 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Κωδικός χώρας με 2 γράμματα, όπως ορίζεται στον κωδικό χώρας ISO 3166-1 alpha-2
{CURRENCYCODE_3}	3 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Κωδικός νομίσματος με 3 γράμματα, όπως ορίζεται στους κωδικούς νομίσματος ISO 4217
{DATEFORMAT}	Μορφότυπος ημερομηνίας ISO 8601	Οι ημερομηνίες θα πρέπει να έχουν τον εξής μορφότυπο: YYYY-MM-DD.
{ISIN}	12 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Κωδικός ISIN, όπως ορίζεται στο ISO 6166
{LEI}	20 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Αναγνωριστικός κωδικός νομικής οντότητας, όπως ορίζεται στο ISO 17442
{MIC}	4 αλφαριθμητικοί χαρακτήρες	Αναγνωριστικός κωδικός αγοράς, όπως ορίζεται στο ISO 10383
{INDEX}	4 αλφαβητικοί χαρακτήρες	«EONA» — EONIA «EONS» — EONIA SWAP «EURI» — Euribor «EUUS» — EURODOLLAR «EUCH» — EuroSwiss «GCFR» — GCF REPO «ISDA» — ISDAFIX «LIBI» — LIBID «LIBO» — LIBOR «MAAA» — Muni AAA «PFAN» — Pfandbriefe «TIBO» — TIBOR «STBO» — STIBOR «BBSW» — BBSW «JIBA» — JIBAR «BUBO» — BUBOR «CDOR» — CDOR «CIBO» — CIBOR «MOSP» — MOSPRIM

▼B

ΣΥΜΒΟΛΟ	ΤΥΠΟΣ ΔΕΔΟΜΕΝΩΝ	ΟΡΙΣΜΟΣ
		«NIBO» — NIBOR «PRBO» — PRIBOR «TLBO» — TELBOR «WIBO» — WIBOR «TREA» — Treasury (Δημόσιο Ταμείο) «SWAP» — SWAP (συμφωνία ανταλλαγής) «FUSW» — Future SWAP (συμφωνία ανταλλαγής μελλοντικής εκπλήρωσης)

Πίνακας 2

Λεπτομέρειες των δεδομένων αναφοράς που πρέπει να παρέχονται για τους σκοπούς των υπολογισμών διαφάνειας

#	ΠΕΔΙΟ	ΛΕΠΤΟΜΕΡΕΙΕΣ ΠΟΥ ΠΡΕΠΕΙ ΝΑ ΑΝΑΦΕΡΟΝΤΑΙ	ΜΟΡΦΟΤΥΠΟΣ ΑΝΑΦΟΡΑΣ
1	Αναγνωριστικός κωδικός μέσου	Κωδικός που χρησιμοποιείται για τον προσδιορισμό του χρηματοπιστωτικού μέσου.	{ISIN}
2	Πλήρης ονομασία μέσου	Πλήρης ονομασία του χρηματοπιστωτικού μέσου	{ALPHANUM-350}
3	Αναγνωριστικός κωδικός MiFIR	**Προσδιορισμός των μη μετοχικών χρηματοπιστωτικών μέσων** **Τιτλοποιημένα παράγωγα**, όπως ορίζονται στο παράρτημα III τμήμα 4 πίνακας 4.1 **Δομημένα χρηματοπιστωτικά προϊόντα (SFP)**, όπως ορίζονται στο άρθρο 2 παράγραφος 1 σημείο 28) του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 600/2014 **Ομολογίες** (για όλες τις ομολογίες πλην των ETC και ETN), όπως ορίζονται στο άρθρο 4 παράγραφος 1 σημείο 44) στοιχείο β) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ **ETC**, όπως ορίζονται στο άρθρο 4 παράγραφος 1 σημείο 44) στοιχείο β) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ και διευκρινίζονται περαιτέρω στο παράρτημα III τμήμα 2 πίνακας 2.4 **ETN**, όπως ορίζονται στο άρθρο 4 παράγραφος 1 σημείο 44) στοιχείο β) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ και διευκρινίζονται περαιτέρω στο παράρτημα III τμήμα 2 πίνακας 2.4 **Δικαιώματα εκπομπής**, όπως ορίζονται στο παράρτημα III τμήμα 12 πίνακας 12.1 **Παράγωγο**, όπως ορίζεται στο παράρτημα I τμήμα Γ 4) έως 10) της οδηγίας 2014/65/ΕΕ	**Μη μετοχικά χρηματοπιστωτικά μέσα:** «SDRV» — Τιτλοποιημένα παράγωγα «SFPS» — Δομημένα χρηματοπιστωτικά προϊόντα (SFP) «BOND» — Ομολογίες «ETCS» — ETC «ETNS» — ETN «EMAL» — Δικαιώματα εκπομπής «DERV» — Παράγωγο
4	Κατηγορία στοιχείων ενεργητικού του υποκείμενου τίτλου	Συμπληρώνεται όταν ο αναγνωριστικός κωδικός MiFIR είναι τιτλοποιημένο παράγωγο ή παράγωγο.	«INTR» — Επιτόκιο «EQUI» — Μετοχή «COMM» — Βασικό εμπόρευμα

▼B

#	ΠΕΔΙΟ	ΛΕΠΤΟΜΕΡΕΙΕΣ ΠΟΥ ΠΡΕΠΕΙ ΝΑ ΑΝΑΦΕΡΟΝΤΑΙ	ΜΟΡΦΟΤΥΠΟΣ ΑΝΑΦΟΡΑΣ
			«CRDT» — Πίστωση «CURR» — Νόμισμα «EMAL» — Δικαιώματα εκπομπής
5	Είδος σύμβασης	Συμπληρώνεται όταν ο αναγνωριστικός κωδικός MiFIR είναι παράγωγο.	«OPTN» — Δικαιώματα προαίρεσης «FUTR» — Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης «FRAS» — Προθεσμιακές συμφωνίες επιτοκίων (FRA) «FORW» — Προθεσμιακές συμφωνίες «SWAP» — Συμφωνίες ανταλλαγής «PSWP» — Συμφωνίες ανταλλαγής χαρτοφυλακίου «SWPT» — Δικαιώματα προαίρεσης σε συμφωνία ανταλλαγής «FONS» — Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης σε συμφωνία ανταλλαγής «FWOS» — Προθεσμιακές συμφωνίες σε συμφωνία ανταλλαγής «FFAS» — Συμφωνίες προθεσμιακής αγοράς ναύλων (FFA) «SPDB» — Τοποθετήσεις επί διαφοράς (spread betting) «CFDS» — Συμβάσεις επί διαφοράς «OTHR» — Άλλο
6	Ημέρα υποβολής αναφοράς	Ημέρα κατά την οποία παρέχονται τα στοιχεία αναφοράς	{DATEFORMAT}
7	Τόπος διαπραγμάτευσης	Κωδικός MIC τμήματος («segment MIC») για τον τόπο διαπραγμάτευσης, εάν είναι διαθέσιμος, ειδάλλως κωδικός MIC λειτουργίας («operational MIC»).	{MIC}
8	Ληκτότητα	Ληκτότητα του χρηματοπιστωτικού μέσου. Πεδίο που ισχύει για τις κατηγορίες στοιχείων ενεργητικού ομολογιών, παραγώγων επί επιτοκίων, παραγώγων επί μετοχών, παραγώγων επί βασικών εμπορευμάτων, παραγώγων επί συναλλάγματος, πιστωτικών παραγώγων, παραγώγων C10 και παραγώγων επί δικαιωμάτων εκπομπής.	{DATEFORMAT}

Πεδία σχετικά με ομολογίες (όλα τα είδη ομολογιών πλην των ETC και ETN)

9	Είδος ομολογίας	Είδος ομολογίας, όπως ορίζεται στο παράρτημα III τμήμα 2 πίνακας 2.2. Συμπληρώνεται μόνον όταν ο αναγνωριστικός κωδικός MiFIR αντιστοιχεί σε ομολογίες.	«EUSB» — Κρατική ομολογία «OEPB» — Άλλες ομολογίες του Δημοσίου «CVTB» — Μετατρέψιμη ομολογία «CVDB» — Καλυμμένη ομολογία «CRPB» — Εταιρική ομολογία «OTHR» — Άλλο
10	Ημερομηνία έκδοσης	Ημερομηνία κατά την οποία εκδίδεται και αρχίζει να τοκίζεται μια ομολογία.	{DATEFORMAT}

▼B

#	ΠΕΔΙΟ	ΛΕΠΤΟΜΕΡΕΙΕΣ ΠΟΥ ΠΡΕΠΕΙ ΝΑ ΑΝΑΦΕΡΟΝΤΑΙ	ΜΟΡΦΟΤΥΠΟΣ ΑΝΑΦΟΡΑΣ
Πεδία σχετικά με δικαιώματα εκπομπής			
Τα πεδία σε αυτό το τμήμα θα πρέπει να συμπληρώνονται μόνον για δικαιώματα εκπομπής, όπως ορίζεται στο παράρτημα III τμήμα 12 πίνακας 12.1			
11	Επιμέρους είδος δικαιωμάτων εκπομπής	Δικαιώματα εκπομπής	«CERE» — Πιστοποιημένη μείωση των εκπομπών (CER) «ERUE» — Μονάδα μείωσης των εκπομπών (ERU) «EUAE» — Γενικά δικαιώματα εκπομπής ΕΕ (EUA) «EUAA» — Δικαιώματα εκπομπής ΕΕ του κλάδου των αερομεταφορών (EUAA)
Πεδία σχετικά με παράγωγα			
Παράγωγα επί βασικών εμπορευμάτων και παράγωγα C10			
12	Προσδιορισμός του μεγέθους που σχετίζεται με το επιμέρους είδος φορτίου	Το πεδίο συμπληρώνεται όταν το προϊόν βάσης που καθορίζεται στον πίνακα 2 πεδίο 35 του παραρτήματος του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/585 αντιστοιχεί σε ναύλο.	{ALPHANUM-25}
13	Ειδική διαδρομή ή μέση χρονοναύλωση	Το πεδίο συμπληρώνεται όταν το προϊόν βάσης που καθορίζεται στον πίνακα 2 πεδίο 35 του παραρτήματος του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/585 αντιστοιχεί σε ναύλο.	{ALPHANUM-25}
14	Τόπος παράδοσης/διακανονισμού σε μετρητά	Το πεδίο συμπληρώνεται όταν το προϊόν βάσης που καθορίζεται στον πίνακα 2 πεδίο 35 του παραρτήματος του κατ' εξουσιοδότηση κανονισμού (ΕΕ) 2017/585 αντιστοιχεί σε ενέργεια.	{ALPHANUM-25}
15	Ονομαστικό νόμισμα	Νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το ονομαστικό ποσό.	{CURRENCYCODE_3}
Παράγωγα επί επιτοκίων			
Τα πεδία σε αυτό το τμήμα θα πρέπει να συμπληρώνονται μόνον για παράγωγα επί επιτοκίων, όπως ορίζεται στο παράρτημα III τμήμα 5 πίνακας 5.1			
16	Είδος υποκείμενου τίτλου	Συμπληρώνεται για είδος σύμβασης διαφορετικό από συμφωνίες ανταλλαγής, δικαιώματα προαίρεσης σε συμφωνία ανταλλαγής, συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης σε συμφωνία ανταλλαγής και προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής με μία από τις ακόλουθες εναλλακτικές Συμπληρώνεται για τα είδη σύμβασης συμφωνίες ανταλλαγής, δικαιώματα προαίρεσης σε συμφωνία ανταλλαγής, συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης σε συμφωνία ανταλλαγής και προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής σε σχέση με την υποκείμενη συμφωνία ανταλλαγής με μία από τις ακόλουθες εναλλακτικές	«BOND» — Ομολογία «BNDF» — Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης επί ομολογιών «INTR» — Επιτόκιο «IFUT» — Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης επί επιτοκίων (FRA) «FFMC» — ΣΥΜΦΩΝΙΕΣ ΑΝΤΑΛΛΑΓΗΣ ΚΥΜΑΙΝΟΜΕΝΟΥ ΜΕ ΚΥΜΑΙΝΟΜΕΝΟ ΕΠΙΤΟΚΙΟ ΣΕ ΠΟΛΛΑ ΝΟΜΙΣΜΑΤΑ «XFMC» — ΣΥΜΦΩΝΙΕΣ ΑΝΤΑΛΛΑΓΗΣ ΣΤΑΘΕΡΟΥ ΜΕ ΚΥΜΑΙΝΟΜΕΝΟ ΕΠΙΤΟΚΙΟ ΣΕ ΠΟΛΛΑ ΝΟΜΙΣΜΑΤΑ «XXMC» — ΣΥΜΦΩΝΙΕΣ ΑΝΤΑΛΛΑΓΗΣ ΣΤΑΘΕΡΟΥ ΜΕ ΣΤΑΘΕΡΟ ΕΠΙΤΟΚΙΟ ΣΕ ΠΟΛΛΑ ΝΟΜΙΣΜΑΤΑ «OSMC» — ΣΥΜΦΩΝΙΕΣ ΑΝΤΑΛΛΑΓΗΣ OIS ΣΕ ΠΟΛΛΑ ΝΟΜΙΣΜΑΤΑ

▼B

#	ΠΕΔΙΟ	ΛΕΠΤΟΜΕΡΕΙΕΣ ΠΟΥ ΠΡΕΠΕΙ ΝΑ ΑΝΑΦΕΡΟΝΤΑΙ	ΜΟΡΦΟΤΥΠΟΣ ΑΝΑΦΟΡΑΣ
			«IFMC» — ΣΥΜΦΩΝΙΕΣ ΑΝΤΑΛΛΑΓΗΣ ΒΑΣΕΙ ΤΟΥ ΠΛΗΘΩΡΙΣΜΟΥ ΣΕ ΠΟΛΛΑ ΝΟΜΙΣΜΑΤΑ «FFSC» — ΣΥΜΦΩΝΙΕΣ ΑΝΤΑΛΛΑΓΗΣ ΚΥΜΑΙΝΟΜΕΝΟΥ ΜΕ ΚΥΜΑΙΝΟΜΕΝΟ ΕΠΙΤΟΚΙΟ ΣΤΟ ΙΔΙΟ ΝΟΜΙΣΜΑ «XFSC» — ΣΥΜΦΩΝΙΕΣ ΑΝΤΑΛΛΑΓΗΣ ΣΤΑΘΕΡΟΥ ΜΕ ΚΥΜΑΙΝΟΜΕΝΟ ΕΠΙΤΟΚΙΟ ΣΤΟ ΙΔΙΟ ΝΟΜΙΣΜΑ «XXSC» — ΣΥΜΦΩΝΙΕΣ ΑΝΤΑΛΛΑΓΗΣ ΣΤΑΘΕΡΟΥ ΜΕ ΣΤΑΘΕΡΟ ΕΠΙΤΟΚΙΟ ΣΤΟ ΙΔΙΟ ΝΟΜΙΣΜΑ «OSSC» — ΣΥΜΦΩΝΙΕΣ ΑΝΤΑΛΛΑΓΗΣ OIS ΣΤΟ ΙΔΙΟ ΝΟΜΙΣΜΑ «IFSC» — ΣΥΜΦΩΝΙΕΣ ΑΝΤΑΛΛΑΓΗΣ ΒΑΣΕΙ ΤΟΥ ΠΛΗΘΩΡΙΣΜΟΥ ΣΤΟ ΙΔΙΟ ΝΟΜΙΣΜΑ
17	Εκδότης της υποκείμενης ομολογίας	Συμπληρώνεται όταν το υποκείμενο είδος είναι ομολογία ή συμβόλαιο μελλοντικής εκπλήρωσης επί ομολογιών, με τον αναγνωριστικό κωδικό νομικής οντότητας (LEI) του εκδότη της άμεσης ή της τελικής υποκείμενης ομολογίας.	{LEI}
18	Ημερομηνία ληκτότητας της υποκείμενης ομολογίας	Συμπληρώνεται με την ημερομηνία ληκτότητας της υποκείμενης ομολογίας. Το πεδίο αφορά χρεωστικούς τίτλους με καθορισμένη ληκτότητα.	{DATEFORMAT}
19	Ημερομηνία έκδοσης της υποκείμενης ομολογίας	Συμπληρώνεται με την ημερομηνία έκδοσης της υποκείμενης ομολογίας	{DATEFORMAT}
20	Ονομαστικό νόμισμα του δικαιώματος προαίρεσης σε συμφωνία ανταλλαγής	Συμπληρώνεται για δικαιώματα προαίρεσης σε συμφωνία ανταλλαγής.	{CURRENCYCODE_3}
21	Ληκτότητα της υποκείμενης συμφωνίας ανταλλαγής	Συμπληρώνεται για δικαιώματα προαίρεσης σε συμφωνίες ανταλλαγής, συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης επί συμφωνιών ανταλλαγής και προθεσμιακές συμφωνίες επί συμφωνίας ανταλλαγής μόνον.	{DATEFORMAT}
22	Κωδικός ISIN δείκτη πληθωρισμού	Στην περίπτωση των δικαιωμάτων προαίρεσης σε συμφωνία ανταλλαγής για έναν από τους ακόλουθους τύπους υποκείμενης συμφωνίας ανταλλαγής: συμφωνία ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού στο ίδιο νόμισμα, συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού στο ίδιο νόμισμα, συμφωνία ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού σε πολλά νομίσματα, συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού σε πολλά νομίσματα· όποτε ο δείκτης πληθωρισμού έχει ISIN, το πεδίο πρέπει να συμπληρώνεται με τον κωδικό ISIN για τον συγκεκριμένο δείκτη.	{ISIN}

▼B

#	ΠΕΔΙΟ	ΛΕΠΤΟΜΕΡΕΙΕΣ ΠΟΥ ΠΡΕΠΕΙ ΝΑ ΑΝΑΦΕΡΟΝΤΑΙ	ΜΟΡΦΟΤΥΠΟΣ ΑΝΑΦΟΡΑΣ
23	Ονομασία δείκτη πληθωρισμού	Συμπληρώνεται με την τυποποιημένη ονομασία του δείκτη, στην περίπτωση των δικαιωμάτων προαίρεσης σε συμφωνία ανταλλαγής για ένα από τα ακόλουθα είδη υποκείμενης συμφωνίας ανταλλαγής: συμφωνία ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού στο ίδιο νόμισμα, συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνίες ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού στο ίδιο νόμισμα, συμφωνία ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού σε πολλά νομίσματα, συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/προθεσμιακές συμβάσεις σε συμφωνία ανταλλαγής βάσει του πληθωρισμού σε πολλά νομίσματα.	{ALPHANUM-25}
24	Επιτόκιο αναφοράς	Ονομασία του επιτοκίου αναφοράς.	{INDEX} ή {ALPHANUM-25} — εάν το επιτόκιο αναφοράς δεν περιλαμβάνεται στον κατάλογο {INDEX}
25	Διάρκεια επιτοκίου της σύμβασης	Σε αυτό το πεδίο αναφέρεται η διάρκεια της σύμβασης. Η διάρκεια εκφράζεται σε ημέρες, εβδομάδες, μήνες ή έτη.	{INTEGER-3}+«DAYS» — ημέρες {INTEGER-3}+«WEEK» — εβδομάδες {INTEGER-3}+«MNTH» — μήνες {INTEGER-3}+«YEAR» — έτη

Παράγωγα επί συναλλάγματος

Τα πεδία σε αυτή την ενότητα θα πρέπει να συμπληρώνονται μόνον για παράγωγα επί συναλλάγματος, όπως ορίζεται στο παράρτημα III τμήμα 8 πίνακας 8.1

26	Επιμέρους είδος σύμβασης	Συμπληρώνεται ώστε να διαφοροποιούνται οι παραδοτέες και οι μη παραδοτέες προθεσμιακές συμβάσεις, τα δικαιώματα προαίρεσης και οι συμφωνίες ανταλλαγής, όπως ορίζεται στο παράρτημα III τμήμα 8 πίνακας 8.1.	«DLVB» — Παραδοτέο «NDLV» — Μη παραδοτέο

Παράγωγα επί μετοχών

Τα πεδία θα πρέπει να συμπληρώνονται για παράγωγα επί μετοχών, όπως ορίζεται στο παράρτημα III τμήμα 6 πίνακας 6.1.

27	Είδος υποκείμενου τίτλου	Συμπληρώνεται όταν ο αναγνωριστικός κωδικός MiFIR είναι παράγωγο, η κατηγορία στοιχείων ενεργητικού του υποκείμενου στοιχείου είναι μετοχή και η κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού δεν είναι ούτε συμφωνίες ανταλλαγής ούτε χαρτοφυλάκιο συμφωνιών ανταλλαγής.	«STIX» — Χρηματιστηριακός δείκτης «SHRS» — Μετοχές «DIVI» — Δείκτης μερισμάτων «DVSE» — Μερίσματα μετοχών «BSKT» — Καλάθι μετοχών που προκύπτει από εταιρική πράξη «ETFS» — ΔΑΚ/ETF «VOLI» — Δείκτης μεταβλητότητας «OTHR» — Άλλο (συμπεριλαμβανομένων πιστοποιητικών αποθετηρίου, πιστοποιητικών και άλλων μετοχικών χρηματοπιστωτικών μέσων)

▼B

#	ΠΕΔΙΟ	ΛΕΠΤΟΜΕΡΕΙΕΣ ΠΟΥ ΠΡΕΠΕΙ ΝΑ ΑΝΑΦΕΡΟΝΤΑΙ	ΜΟΡΦΟΤΥΠΟΣ ΑΝΑΦΟΡΑΣ
		Συμπληρώνεται όταν ο αναγνωριστικός κωδικός MiFIR είναι παράγωγο, η κατηγορία στοιχείων ενεργητικού του υποκείμενου στοιχείου είναι μετοχή, η κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού είναι είτε συμφωνίες ανταλλαγής είτε χαρτοφυλάκιο συμφωνιών ανταλλαγής και το κριτήριο κατάτμησης 2 που ορίζεται στο παράρτημα III τμήμα 6 πίνακας 6.1 είναι μεμονωμένος πιστούχος.	«SHRS» — Μετοχές «DVSE» — Μερίσματα μετοχών «ETFS» — ΔΑΚ/ETF «OTHR» — Άλλο (συμπεριλαμβανομένων πιστοποιητικών αποθετηρίου, πιστοποιητικών και άλλων μετοχικών χρηματοπιστωτικών μέσων)
		Συμπληρώνεται όταν ο αναγνωριστικός κωδικός MiFIR είναι παράγωγο, η κατηγορία στοιχείων ενεργητικού του υποκείμενου στοιχείου είναι μετοχή, η κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού είναι είτε συμφωνίες ανταλλαγής είτε χαρτοφυλάκιο συμφωνιών ανταλλαγής και το κριτήριο κατάτμησης 2 που ορίζεται στο παράρτημα III τμήμα 6 πίνακας 6.1 είναι δείκτης.	«STIX» — Χρηματιστηριακός δείκτης «DIVI» — Δείκτης μερισμάτων «VOLI» — Δείκτης μεταβλητότητας «OTHR» — Άλλο
		Συμπληρώνεται όταν ο αναγνωριστικός κωδικός MiFIR είναι παράγωγο, η κατηγορία στοιχείων ενεργητικού του υποκείμενου στοιχείου είναι μετοχή, η κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού είναι είτε συμφωνίες ανταλλαγής είτε χαρτοφυλάκιο συμφωνιών ανταλλαγής και το κριτήριο κατάτμησης 2 που ορίζεται στο παράρτημα III τμήμα 6 πίνακας 6.1 είναι καλάθι.	«BSKT» — Καλάθι
28	Παράμετρος	Συμπληρώνεται όταν ο αναγνωριστικός κωδικός MiFIR είναι παράγωγο, η κατηγορία στοιχείων ενεργητικού του υποκείμενου στοιχείου είναι μετοχή και η κατηγορία επιμέρους στοιχείων ενεργητικού είναι ένα από τα εξής: συμφωνίες ανταλλαγής, συμφωνίες ανταλλαγής χαρτοφυλακίου.	«PRBP» — Βασική παράμετρος απόδοσης με επιστροφή του αντιτίμου «PRDV» — Παράμετρος μερισματικής απόδοσης «PRVA» — Παράμετρος διακύμανσης της απόδοσης «PRVO» — Παράμετρος μεταβλητότητας της απόδοσης

Συμβάσεις επί διαφοράς (CFD)

Τα πεδία θα πρέπει να συμπληρώνονται μόνον όταν ο τύπος της σύμβασης είναι σύμβαση επί διαφοράς ή τοποθέτηση επί διαφοράς (spread betting).

29	Είδος υποκείμενου τίτλου	Συμπληρώνεται όταν ο αναγνωριστικός κωδικός MiFIR είναι παράγωγο και το είδος της σύμβασης αντιστοιχεί σε σύμβαση επί διαφοράς ή τοποθέτηση επί διαφοράς (spread betting).	«CURR» — Νόμισμα «EQUI» — Μετοχή «BOND» — Ομολογίες «FTEQ» — Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης επί μετοχής «OPEQ» — Δικαιώματα προαίρεσης επί μετοχής «COMM» — Βασικό εμπόρευμα «EMAL» — Δικαιώματα εκπομπής «OTHR» — Άλλο
30	Ονομαστικό νόμισμα 1	Νόμισμα 1 του υποκείμενου ζεύγους νομισμάτων. Το πεδίο αυτό ισχύει όταν το είδος υποκείμενου τίτλου είναι νόμισμα.	{CURRENCYCODE_3}

▼B

#	ΠΕΔΙΟ	ΛΕΠΤΟΜΕΡΕΙΕΣ ΠΟΥ ΠΡΕΠΕΙ ΝΑ ΑΝΑΦΕΡΟΝΤΑΙ	ΜΟΡΦΟΤΥΠΟΣ ΑΝΑΦΟΡΑΣ
31	Ονομαστικό νόμισμα 2	Νόμισμα 2 του υποκείμενου ζεύγους νομισμάτων. Το πεδίο αυτό ισχύει όταν το είδος υποκείμενου τίτλου είναι νόμισμα.	{CURRENCYCODE_3}
Πιστωτικά παράγωγα			
32	Κωδικός ISIN της υποκείμενης συμφωνίας ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης	Συμπληρώνεται για παράγωγα επί συμφωνιών ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης με τον κωδικό ISIN της υποκείμενης συμφωνίας ανταλλαγής.	{ISIN}
33	Κωδικός του υποκείμενου δείκτη	Συμπληρώνεται για παράγωγα επί δείκτη CDS με τον κωδικό ISIN του δείκτη.	{ISIN}
34	Ονομασία του υποκείμενου δείκτη	Συμπληρώνεται για παράγωγα επί δείκτη CDS με την τυποποιημένη ονομασία του δείκτη.	{ALPHANUM-25}
35	Σειρά	Ο αριθμός σειράς της σύνθεσης του δείκτη, εάν ισχύει. Συμπληρώνεται για δείκτη CDS ή παράγωγο επί δείκτη CDS με τη σειρά του δείκτη CDS.	{DECIMAL-18/17}
36	Έκδοση	Νέα έκδοση της σειράς εκδίδεται εάν ένα από τα στοιχεία παρουσιάσει αθέτηση και ο δείκτης πρέπει να σταθμιστεί εκ νέου, ώστε να αντιστοιχεί στον νέο αριθμό του συνόλου των στοιχείων που συνθέτουν τον δείκτη. Συμπληρώνεται για δείκτη CDS ή παράγωγο επί δείκτη CDS με την έκδοση του δείκτη CDS.	{DECIMAL-18/17}
37	Μήνες ανανέωσης	Όλοι οι μήνες κατά τους οποίους αναμένεται ανανέωση, όπως καθορίζεται από τον πάροχο του δείκτη για ένα δεδομένο έτος. Το πεδίο θα πρέπει να επαναλαμβάνεται για κάθε μήνα της ανανέωσης. Συμπληρώνεται για δείκτη CDS ή παράγωγο επί δείκτη CDS.	«01», «02», «03», «04», «05», «06», «07», «08», «09», «10», «11», «12»
38	Ημερομηνία επόμενης ανανέωσης	Συμπληρώνεται στην περίπτωση δείκτη CDS ή παραγώγου επί δείκτη CDS με την επόμενη ημερομηνία ανανέωσης του δείκτη, όπως καθορίζεται από τον πάροχο του δείκτη.	{DATEFORMAT}
39	Εκδότης κρατικού και δημόσιου τύπου	Συμπληρώνεται όταν η οντότητα αναφοράς ενός CDS μεμονωμένου πιστούχου ή παράγωγου επί CDS μεμονωμένου πιστούχου είναι κρατικός εκδότης, όπως ορίζεται στο παράρτημα III τμήμα 9 πίνακας 9.1.	«TRUE» — η οντότητα αναφοράς είναι εκδότης κρατικού και δημόσιου τύπου «FALSE» — η οντότητα αναφοράς δεν είναι εκδότης κρατικού και δημόσιου τύπου
40	Υποχρέωση αναφοράς	Συμπληρώνεται για ένα παράγωγο επί συμφωνίας ανταλλαγής κινδύνου αθέτησης μεμονωμένου πιστούχου με το ISIN της υποχρέωσης αναφοράς.	{ISIN}

▼B

#	ΠΕΔΙΟ	ΛΕΠΤΟΜΕΡΕΙΕΣ ΠΟΥ ΠΡΕΠΕΙ ΝΑ ΑΝΑΦΕΡΟΝΤΑΙ	ΜΟΡΦΟΤΥΠΟΣ ΑΝΑΦΟΡΑΣ
41	Οντότητα αναφοράς	Συμπληρώνεται με την οντότητα αναφοράς CDS μεμονωμένου πιστούχου ή παραγώγου επί CDS μεμονωμένου πιστούχου.	{COUNTRYCODE_2} ή Κωδικός χώρας με 2 γράμματα, βάσει του ISO 3166-2, που ακολουθείται από παύλα «-» και κωδικό υποδιαίρεσης χώρας με έως 3 αλφαριθμητικούς χαρακτήρες ή {LEI}
42	Ονομαστικό νόμισμα	Νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το ονομαστικό ποσό.	{CURRENCYCODE_3}

Παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής

Τα πεδία σε αυτό το τμήμα θα πρέπει να συμπληρώνονται μόνον για παράγωγα επί δικαιωμάτων εκπομπής, όπως ορίζεται στο παράρτημα III τμήμα 13 πίνακας 13.1

43	Επιμέρους είδος παραγώγων επί δικαιωμάτων εκπομπής	Συμπληρώνεται όταν η μεταβλητή #3 «αναγνωριστικός κωδικός MiFIR» είναι «DERV» — παράγωγο και η μεταβλητή #4 «κατηγορία στοιχείων ενεργητικού του υποκείμενου τίτλου» είναι «EMAL» — δικαιώματα εκπομπής.	«CERE» — Πιστοποιημένη μείωση των εκπομπών (CER) «ERUE» — Μονάδα μείωσης των εκπομπών (ERU) «EUAE» — Γενικά δικαιώματα εκπομπής ΕΕ (EUA) «EUAA» — Δικαιώματα εκπομπής ΕΕ του κλάδου των αερομεταφορών (EUAA) «OTHR» — Άλλο