Tento dokument slouží výhradně k informačním účelům a nemá žádný právní účinek. Orgány a instituce Evropské unie nenesou za jeho obsah žádnou odpovědnost. Závazná znění příslušných právních předpisů, včetně jejich právních východisek a odůvodnění, jsou zveřejněna v Úředním věstníku Evropské unie a jsou k dispozici v databázi EUR-Lex. Tato úřední znění jsou přímo dostupná přes odkazy uvedené v tomto dokumentu

►B

NAŘÍZENÍ KOMISE V PŘENESENÉ PRAVOMOCI (EU) 2017/583

ze dne 14. července 2016,

kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014 o trzích finančních nástrojů, pokud jde o regulační technické normy týkající se požadavků na transparentnost pro obchodní systémy a investiční podniky v souvislosti s dluhopisy, strukturovanými finančními produkty, povolenkami na emise a deriváty

(Text s významem pro EHP)

(Úř. věst. L 87, 31.3.2017, s. 229)

Ve znění:

		Úřední věstník		
		Č.	Strana	Datum
►M1	Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2021/529 ze dne 18. prosince 2020	L 106	49	26.3.2021
►M2	Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2022/629 ze dne 12. ledna 2022	L 115I	1	13.4.2022
►M3	Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2023/945 ze dne 17. ledna 2023	L 131	17	16.5.2023
►M4	Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2025/1246 ze dne 18. června 2025	L 1246	1	3.11.2025

Opraveno:

►C1 Oprava, Úř. věst. L 90102, 21.11.2023, s. 1 (2023/945)

▼B

NAŘÍZENÍ KOMISE V PŘENESENÉ PRAVOMOCI (EU) 2017/583

ze dne 14. července 2016,

kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014 o trzích finančních nástrojů, pokud jde o regulační technické normy týkající se požadavků na transparentnost pro obchodní systémy a investiční podniky v souvislosti s dluhopisy, strukturovanými finančními produkty, povolenkami na emise a deriváty

(Text s významem pro EHP)

KAPITOLA I

DEFINICE

▼M4

Článek 1

Definice

(čl. 9 odst. 5 písm. f) nařízení (EU) č. 600/2014)

Pro účely tohoto nařízení se použijí tyto definice:

1) „systémem obchodování prostřednictvím centrální knihy limitních pokynů“ se rozumí kterýkoli z těchto systémů obchodování:

   a) systém obchodování formou průběžné aukce na základě knihy objednávek, který prostřednictvím knihy objednávek a obchodního algoritmu provozovaného bez lidského zásahu průběžně páruje pokyny k prodeji s pokyny ke koupi podle nejlepší dostupné ceny;

   b) systém obchodování kombinující prvky systému obchodování formou průběžné aukce na základě knihy objednávek uvedeného v písmeni a) a systému obchodování formou periodických aukcí definovaného v bodě 2;

2) „systémem obchodování formou periodických aukcí“ se rozumí systém obchodování, který páruje pokyny na základě periodické aukce a obchodního algoritmu provozovaného bez lidského zásahu.

Článek 1a

Oblast působnosti článků 3, 6, 8, 9, 10, 11 a 13

1. Články 3, 6, 9, 10, 11 a 13 se vztahují pouze na deriváty. Článek 8 se vztahuje pouze na deriváty a souborné obchody.

2. Odkazy na článek 11 nařízení (EU) č. 600/2014 v článcích 8 a 11 tohoto nařízení se považují za odkazy na článek 11 nařízení (EU) č. 600/2014 ve znění použitelném před 28. březnem 2024.

▼B

KAPITOLA II

PŘEDOBCHODNÍ TRANSPARENTNOST PRO REGULOVANÉ TRHY, MNOHOSTRANNÉ OBCHODNÍ SYSTÉMY A ORGANIZOVANÉ OBCHODNÍ SYSTÉMY

Článek 2

Povinnosti týkající se předobchodní transparentnosti

(čl. 8 odst. 1 a 2 nařízení (EU) č. 600/2014)

Organizátoři trhu a investiční podniky provozující obchodní systém uveřejňují rozsah kupních a prodejních cen, jakož i intenzitu obchodních zájmů na uvedených cenách v souladu s druhem obchodního systému, který provozují, a požadavky na informace, jak jsou stanoveny v příloze 1.

Článek 3

Pokyny velkého rozsahu

(čl. 9 odst. 1 písm. a) nařízení (EU) č. 600/2014)

Pokyn je velkého rozsahu v porovnání s běžným tržním objemem, pokud je v době zápisu pokynu nebo po jakékoli změně pokynu roven nebo větší než minimální velikost pokynu, která se stanoví v souladu s metodikou uvedenou v článku 13.

▼M4

Článek 3a

Pokyny velkého rozsahu pro dluhopisy, strukturované finanční produkty a povolenky na emise

(čl. 9 odst. 1 písm. a) nařízení (EU) č. 600/2014)

Pokyn k obchodování s dluhopisy, strukturovanými finančními produkty nebo povolenkami na emise je velkého rozsahu v porovnání s běžným tržním objemem, pokud je v době zápisu pokynu nebo po jakékoli změně pokynu roven nebo větší než tyto prahové hodnoty:

a) pro všechny druhy dluhopisů s výjimkou komodit obchodovaných v obchodním systému (dále jen „ETC“) a dluhových cenných papírů obchodovaných v obchodním systému (dále jen „ETN“) prahové hodnoty stanovené v tabulce 2.3 přílohy III;

b) pro ETC a ETN prahové hodnoty stanovené v tabulce 2.5 přílohy III;

c) pro strukturované finanční produkty prahové hodnoty stanovené v tabulce 3.2 přílohy III;

d) pro povolenky na emise prahové hodnoty stanovené v tabulce 12.2 přílohy III.

▼B

Článek 4

Druh a minimální velikost pokynů uchovávaných v systému na správu pokynů

(čl. 9 odst. 1 písm. a) nařízení (EU) č. 600/2014)

1. Pokyn uchovávaný až do uveřejnění v systému na správu pokynů obchodního systému, u kterého mohou být prominuty povinnosti týkající se předobchodní transparentnosti, je tohoto druhu:

a) má být uveřejněn v knize objednávek provozované obchodním systémem a je závislý na objektivních podmínkách, které jsou předem definované v protokolu systému;

b) vzájemně se neovlivňuje s jinými obchodními zájmy před uveřejněním v knize objednávek provozované obchodním systémem;

c) jakmile je uveřejněn v knize objednávek, vzájemně se ovlivňuje s jinými pokyny v souladu s pravidly platnými pro pokyny daného druhu v době uveřejnění.

2. Pokyny uchovávané až do uveřejnění v systému na správu pokynů obchodního systému, u kterých mohou být prominuty povinnosti týkající se předobchodní transparentnosti, mají v době zápisu a po jakékoli změně jednu z těchto minimálních velikostí:

a) v případě záložního pokynu velikost větší nebo rovnou 10 000 EUR;

b) pro veškeré další pokyny velikost větší nebo rovnou minimálnímu obchodovatelnému množství předem stanovenému provozovatelem systému podle pravidel a protokolů systému.

3. Za záložní pokyn uvedený v čl. 2 písm. a) se považuje limitní pokyn skládající se z uveřejněného pokynu vztahujícího se k části množství a neuveřejněného pokynu vztahujícího se ke zbytku množství v případě, kdy je neuveřejněné množství schopné provedení pouze poté, co je uvolněno do knihy objednávek jako nový uveřejněný pokyn.

▼M3

4. Pro účely odst. 2 písm. a) se velikost pokynů uchovávaných v systému na správu pokynů měří pomyslnou částkou obchodovaných smluv podle přílohy II tabulky 2 pole 10.

▼M4

———————

▼B

Článek 6

Kategorie finančních nástrojů, pro které neexistuje likvidní trh

(čl. 9 odst. 1 písm. c) nařízení (EU) č. 600/2014)

Finanční nástroj nebo kategorie finančních nástrojů se považují za nástroje, pro které neexistuje likvidní trh, pokud je tak stanoveno v souladu s metodikou uvedenou v článku 13.

▼M4

Článek 6a

Kategorie dluhopisů, strukturovaných finančních produktů a povolenek na emise, pro které neexistuje likvidní trh

(čl. 9 odst. 1 písm. c) nařízení (EU) č. 600/2014)

Pro určení toho, zda se dluhopis, strukturovaný finanční produkt nebo povolenka na emise považuje za dluhopis, strukturovaný finanční produkt nebo povolenku na emise, pro které neexistuje likvidní trh, použijí příslušné orgány tento statický způsob určení likvidity:

a) pro všechny druhy dluhopisů s výjimkou ETC a ETN způsob stanovený v tabulce 2.2 přílohy III;

b) pro ETC a ETN způsob stanovený v tabulce 2.4 přílohy III;

c) pro strukturované finanční produkty způsob stanovený v tabulce 3.1 přílohy III;

d) pro povolenky na emise způsob stanovený v tabulce 12.1 přílohy III.

▼B

KAPITOLA III

POOBCHODNÍ TRANSPARENTNOST PRO OBCHODNÍ SYSTÉMY A INVESTIČNÍ PODNIKY OBCHODUJÍCÍ MIMO RÁMEC OBCHODNÍHO SYSTÉMU

Článek 7

Povinnosti týkající se poobchodní transparentnosti

(čl. 10 odst. 1 a čl. 21 odst. 1 a 5 nařízení (EU) č. 600/2014)

1. Investiční podniky obchodující mimo rámec pravidel obchodního systému a organizátoři trhu a investiční podniky provozující obchodní systém uveřejní s odkazem na každý obchod podrobnosti stanovené v tabulkách 1 a 2 přílohy II a použijí veškerá příslušná označení uvedená v tabulce 3 přílohy II.

▼M4

Názvy polí uvedené v tabulce 2 přílohy II se uveřejní za použití stejných pravidel pro označování, jaká jsou stanovena v identifikátoru pole uvedené tabulky.

▼B

2. V případě, že je dříve uveřejněná zpráva o obchodu zrušena, investiční podniky obchodující mimo rámec obchodního systému a organizátoři trhu a investiční podniky provozující obchodní systém uveřejní novou zprávu o obchodu, která zahrnuje veškeré podrobnosti z původní zprávy o obchodu a označení zrušení specifikované v tabulce 3 přílohy II.

3. V případě, že je dříve uveřejněná zpráva o obchodu pozměněna, investiční podniky obchodující mimo rámec obchodního systému, organizátoři trhu a investiční podniky provozující obchodní systém uveřejní tyto informace:

a) novou zprávu o obchodu, která obsahuje veškeré podrobnosti z původní zprávy o obchodu a označení zrušení specifikované v tabulce 3 přílohy II;

b) novou zprávu o obchodu, která obsahuje veškeré podrobnosti z původní zprávy o obchodu se zanesenými všemi potřebnými změnami a označením změny specifikovaným v tabulce 3 přílohy II.

▼M4

4. Poobchodní informace se zpřístupní v okamžiku co nejbližším reálnému času, jak je to jen technicky možné, v každém případě pak do pěti minut po provedení příslušného obchodu.

_____

▼B

7. Investiční podniky přijmou veškerá přiměřená opatření k zajištění toho, aby byl obchod uveřejněn jako jediný obchod. Z toho důvodu se dva odpovídající obchody uzavřené ve stejnou dobu a za stejnou cenu s jedinou protistranou považují za jediný obchod.

▼M4

8. Informace týkající se souborného obchodu zahrnují označení souborného obchodu nebo označení výměny za hmotná aktiva specifikované v tabulce 3 přílohy II. V případě, že je souborný obchod způsobilý k odkladu uveřejnění podle článku 8, zpřístupní se informace týkající se všech složek až poté, co ve vztahu k danému obchodu uplyne doba odkladu.

▼B

Článek 8

Odklad uveřejnění obchodů

(čl. 11 odst. 1 a 3 a čl. 21 odst. 4 nařízení (EU) č. 600/2014)

1. Pokud příslušný orgán povolí odklad uveřejnění podrobností o obchodu podle čl. 11 odst. 1 nařízení (EU) č. 600/2014, uveřejní investiční podniky obchodující mimo rámec obchodního systému, organizátoři trhu a investiční podniky provozující obchodní systém každý obchod nejpozději do 19:00 hod. místního času druhého pracovního dne po dni provedení obchodu za předpokladu, že je splněna jedna z těchto podmínek:

a) obchod je velkého rozsahu v porovnání s běžným tržním objemem, jak je uvedeno v článku 9;

▼B

b) jedná se o obchod s finančním nástrojem nebo kategorií finančních nástrojů, pro které neexistuje likvidní trh, jak je stanoveno v souvislosti s metodikou uvedenou v článku 13;

c) obchod se uskutečňuje mezi investičním podnikem obchodujícím na vlastní účet jiným způsobem než párováním pokynů na vlastní účet podle čl. 4 odst. 1 bodu 38 směrnice Evropského parlamentu a Rady 2014/65/EU ([1]) a jinou protistranou, přičemž je větší než konkrétní objem pro daný nástroj stanovený v článku 10;

d) jedná se o souborný obchod, který splňuje jedno z těchto kritérií:

i) jedna nebo více jeho složek jsou obchody s finančními nástroji, pro které neexistuje likvidní trh;

ii) jedna nebo více jeho složek jsou obchody s finančními nástroji, které jsou velkého rozsahu v porovnání s běžným tržním objemem, jak je uvedeno v článku 9;

iii) obchod se uskutečňuje mezi investičním podnikem obchodujícím na vlastní účet jiným způsobem než párováním pokynů na vlastní účet podle čl. 4 odst. 1 bodu 38 směrnice 2014/65/EU a jinou protistranou, přičemž jedna nebo více jeho složek jsou obchody s finančními nástroji, které jsou větší než konkrétní objem pro daný nástroj stanovený v článku 10.

2. Po uplynutí doby odkladu stanovené v odstavci 1 se uveřejní veškeré podrobnosti obchodu, pokud není přiznána prodloužená nebo neomezená doba odkladu v souladu s článkem 11.

3. Je-li obchod mezi dvěma investičními podniky, ať už na vlastní účet nebo jménem zákazníka, proveden mimo rámec pravidel obchodního systému, je příslušným orgánem pro účely určení rozhodného režimu odkladu příslušný orgán toho investičního podniku, který je odpovědný za uveřejnění obchodu prostřednictvím schváleného systému pro uveřejňování informací v souladu s čl. 7 odst. 5, 6 a 7.

▼M4

Článek 8a

Odklad uveřejnění obchodů u dluhopisů, strukturovaných finančních produktů a povolenek na emise

(článek 11 nařízení (EU) č. 600/2014)

1. Organizátoři trhu a investiční podniky provozující obchodní systém a investiční podniky obchodující mimo rámec obchodního systému mohou odložit uveřejnění podrobností o obchodech s dluhopisy s výjimkou ETC a ETN v souladu s těmito podmínkami:

([1]) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2014/65/EU ze dne 15. května 2014 o trzích finančních nástrojů a o změně směrnic 2002/92/ES a 2011/61/EU (Úř. věst. L 173, 12.6.2014, s. 349).

▼M4

a) u obchodů v kategorii 1 uvedených v tabulce 2.6 přílohy III odklad uveřejnění ceny a odklad uveřejnění objemu nepřesahují 15 minut;

b) u obchodů kategorie 2 uvedených v tabulce 2.6 přílohy III odklad uveřejnění ceny a odklad uveřejnění objemu nepřesahují konec obchodovacího dne;

c) u obchodů kategorie 3 uvedených v tabulce 2.6 přílohy III odklad uveřejnění ceny nepřesahuje konec prvního obchodovacího dne po datu obchodu a odklad uveřejnění objemu nepřesahuje jeden týden po datu obchodu;

d) u obchodů kategorie 4 uvedených v tabulce 2.6 přílohy III odklad uveřejnění ceny nepřesahuje konec druhého obchodovacího dne po datu obchodu a odklad uveřejnění objemu nepřesahuje dva týdny po datu obchodu;

e) u obchodů kategorie 5 uvedených v tabulce 2.6 přílohy III odklad uveřejnění ceny a odklad uveřejnění objemu nepřesahují čtyři týdny po datu obchodu.

2. Organizátoři trhu a investiční podniky provozující obchodní systém a investiční podniky obchodující mimo rámec obchodního systému mohou odložit uveřejnění podrobností o obchodech s ETC, ETN a strukturovanými finančními produkty v souladu s těmito podmínkami:

a) odklad uveřejnění ceny u obchodů jakéhokoli objemu nepřesahuje konec druhého obchodovacího dne po datu obchodu a

b) odklad uveřejnění objemu u obchodů jakéhokoli objemu nepřesahuje dva týdny po datu obchodu.

3. Organizátoři trhu a investiční podniky provozující obchodní systém a investiční podniky obchodující mimo rámec obchodního systému uveřejní každý obchod s povolenkami na emise nejpozději do 19:00 hod. místního času druhého pracovního dne po datu obchodu za předpokladu, že obchod je větší než poobchodní objem pro obchody s povolenkami na emise podle tabulky 12.2 přílohy III.

▼B

Článek 9

Obchody velkého rozsahu

(čl. 11 odst. 1 písm. a) nařízení (EU) č. 600/2014)

Obchod je velkého rozsahu v porovnání s běžným tržním objemem, pokud je roven nebo větší než minimální objem obchodu, který se vypočítá v souladu s metodikou uvedenou v článku 13.

▼B

Článek 10

Konkrétní objem pro daný finanční nástroj

(čl. 11 odst. 1 písm. c) nařízení (EU) č. 600/2014)

Obchod je větší než konkrétní objem pro daný finanční nástroj, pokud je roven nebo větší než minimální objem obchodu, který se vypočítá v souladu s metodikou uvedenou v článku 13.

Článek 11

Požadavky na transparentnost ve spojení s odkladem uveřejnění podle uvážení příslušných orgánů

(čl. 11 odst. 3 nařízení (EU) č. 600/2014)

1. V případě, že příslušné orgány vykonávají svou pravomoc ve spojení s povolením odkladu uveřejnění podle čl. 11 odst. 3 nařízení (EU) č. 600/2014, platí následující:

a) pokud se uplatní čl. 11 odst. 3 písm. a) nařízení (EU) č. 600/2014, příslušné orgány si vyžádají uveřejnění některé z těchto informací po celou dobu odkladu, jak je uvedeno v článku 8:

   i) veškeré podrobnosti obchodu stanovené v tabulkách 1 a 2 přílohy II s výjimkou podrobností týkajících se objemu;

   ii) při minimálním počtu 5 obchodů uzavřených ve stejném dni se obchody uveřejní v souhrnné podobě následující pracovní den do 9:00 hod. místního času;

b) pokud se uplatní čl. 11 odst. 3 písm. b) nařízení (EU) č. 600/2014, příslušné orgány umožní neuveřejňovat objem jednotlivých obchodů po prodlouženou dobu čtyř týdnů;

c) pokud jde o nekapitálové nástroje jiné než veřejnoprávní dluhopisy, a pokud se uplatní čl. 11 odst. 3 písm. c) nařízení (EU) č. 600/2014, příslušné orgány umožní po prodlouženou dobu odkladu čtyř týdnů uveřejnění několika obchodů uzavřených v průběhu jednoho kalendářního týdne v souhrnné podobě následující úterý do 9:00 hod. místního času.

▼M4

_____

▼B

2. V případě uplynutí prodloužené doby odkladu stanovené v odst. 1 písm. b) se uplatní tyto požadavky:

a) pokud jde o nástroje jiné než veřejnoprávní dluhopisy, uveřejnění úplných podrobností veškerých jednotlivých obchodů, a to následující pracovní den do 9:00 hod. místního času.

▼M4

_____

▼B

3. Pokud jde o nástroje jiné než veřejnoprávní dluhopisy, veškeré podrobnosti o jednotlivých obchodech se uveřejní čtyři týdny po uveřejnění souhrnných podrobností v souladu odst. 1 písm. c) do 9:00 hod. místního času.

▼M4

4. Souhrnné denní nebo týdenní údaje uvedené v odstavcích 1 a 2 zahrnují následující informace o derivátech, a to ve vztahu ke každému dni nebo týdnu příslušného kalendářního období:

a) váženou průměrnou cenu;

b) celkový obchodovaný objem uvedený v tabulce 4 přílohy II;

c) celkový počet obchodů.

▼B

5. Souhrny obchodů se tvoří na základě kódu ISIN. V případě, že kód ISIN není k dispozici, tvoří se souhrny obchodů na úrovni kategorie finančních nástrojů, na které se vztahuje zkouška likvidity stanovená v článku 13.

▼M4

6. V případě, že den uveřejnění stanovený v odst. 1 písm. c) a odstavcích 2 a 3 není pracovním dnem, dojde k uveřejnění následující pracovní den do 9:00 hod. místního času.

Článek 11a

Požadavky na transparentnost u veřejnoprávních dluhopisů ve spojení s odkladem uveřejnění podle uvážení příslušných orgánů

(čl. 11 odst. 3 nařízení (EU) č. 600/2014)

1. Uveřejňování podrobností o několika obchodech v souhrnné podobě podle čl. 11 odst. 3 písm. b) nařízení (EU) č. 600/2014 se vztahuje na obchody, které byly uzavřeny v průběhu jednoho kalendářního týdne, a provádí se následující úterý do 9:00 hod. místního času.

2. Souhrnné týdenní údaje uvedené v odstavci 1 zahrnují následující informace ve vztahu ke každému týdnu příslušného kalendářního období:

a) váženou průměrnou cenu;

b) celkový obchodovaný objem uvedený v tabulce 4 přílohy II;

c) celkový počet obchodů.

3. Souhrny obchodů se tvoří na základě kódu ISIN.

4. V případě, že den uveřejnění stanovený v odstavci 1 není pracovním dnem, dojde k uveřejnění následující pracovní den do 9:00 hod. místního času.

▼M3

Článek 12

Použití poobchodní transparentnosti pro určité druhy obchodů prováděných mimo rámec obchodního systému

(čl. 21 odst. 1 nařízení (EU) č. 600/2014)

Povinnosti stanovené v čl. 21 odst. 1 nařízení (EU) č. 600/2014 se neuplatní na obchody uvedené v čl. 2 odst. 5 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 ([1]).

▼B

KAPITOLA IV

SPOLEČNÁ USTANOVENÍ PRO PŘEDOBCHODNÍ A POOBCHODNÍ TRANSPARENTNOST

Článek 13

Metodika provádění výpočtů transparentnosti

(čl. 9 odst. 1 a 2, čl. 11 odst. 1 a čl. 22 odst. 1 nařízení (EU) č. 600/2014)

1. Pro určení finančních nástrojů a kategorií finančních nástrojů, pro které neexistuje likvidní trh pro účely článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), se použijí napříč kategoriemi aktiv tyto metodiky:

a) statický způsob určení likvidity pro:

i) kategorii aktiv sekuritizovaných derivátů, jak jsou definovány v tabulce 4.1 přílohy III;

ii) následující podkategorie aktiv kapitálových derivátů: indexové opce, indexové futures/forwardy, akciové opce, akciové futures/forwardy, opce vázané na dividendu indexu, futures/forwardy vázané na dividendu indexu, opce vázané na volatilitu indexu, futures/forwardy vázané na volatilitu indexu, ETF opce, ETF futures/forwardy a ostatní kapitálové deriváty, jak jsou definovány v tabulce 6.1 přílohy III;

iii) kategorii aktiv devizových derivátů, jak jsou definovány v tabulce 8.1 přílohy III;

▼M4

iv) podkategorie aktiv ostatních úrokových derivátů, ostatních komoditních derivátů, ostatních úvěrových derivátů, ostatních derivátů C10, ostatních rozdílových smluv a ostatních derivátů povolenek na emise, jež jsou uvedeny v tabulkách 5.1, 7.1, 9.1, 10.1, 11.1 a 13.1 přílohy III;

([1]) Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 ze dne 28. července 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014, pokud jde o regulační technické normy pro hlášení obchodů příslušným orgánům (Úř. věst. L 87, 31.3.2017, s. 449).

▼B

b) pravidelné hodnocení na základě kvantitativního a případně kvalitativního kritéria likvidity pro:

▼M4

_____

▼B

iii) kategorii aktiv úrokových derivátů s výjimkou podkategorie aktiv ostatních úrokových derivátů, jak jsou definovány v tabulce 5.1 přílohy III;

iv) tyto podkategorie aktiv kapitálových derivátů: swapy a swapy portfolia, jak jsou definovány v tabulce 6.1 přílohy III;

v) kategorii aktiv komoditních derivátů s výjimkou podkategorie ostatních komoditních derivátů, jak jsou definovány v tabulce 7.1 přílohy III;

vi) tyto podkategorie aktiv úvěrových derivátů: swapy úvěrového selhání založené na indexu a swapy úvěrového selhání na jedno jméno, jak jsou definovány v tabulce 9.1 přílohy III;

vii) kategorii aktiv derivátů C10 s výjimkou podkategorie aktiv ostatních derivátů C10, jak jsou definovány v tabulce 10.1 přílohy III;

viii) tyto podkategorie aktiv rozdílových smluv: měnové rozdílové smlouvy a komoditní rozdílové smlouvy, jak jsou definovány v tabulce 11.1 přílohy III;

▼M4

_____

▼B

x) kategorii aktiv derivátů povolenek na emise s výjimkou podkategorie aktiv ostatních derivátů povolenek na emise, jak jsou definovány v tabulce 13.1 přílohy III;

c) pravidelné hodnocení na základě kvalitativního kritéria likvidity pro:

i) tyto podkategorie aktiv úvěrových derivátů: indexové opce CDS (swapu úvěrového selhání) a CDS opce na jedno jméno, jak jsou definovány v tabulce 9.1 přílohy III;

ii) tyto podkategorie aktiv rozdílových smluv: akciové rozdílové smlouvy, dluhopisové rozdílové smlouvy, rozdílové smlouvy na akciové futures/forwardy a rozdílové smlouvy na akciové opce, jak jsou definovány v tabulce 11.1 přílohy III.

▼M4

_____

▼B

2. ►M4 Pro určení pokynů velkého rozsahu v porovnání s běžným tržním objemem uvedených v článku 3 se použijí tyto metodiky: ◄

a) prahová hodnota pro:

▼M4

_____

▼B

ii) kategorii aktiv sekuritizovaných derivátů, jak jsou definovány v tabulce 4.2 přílohy III;

iii) všechny podkategorie akciových derivátů, jak jsou definovány v tabulkách 6.2 a 6.3 přílohy III;

iv) všechny podkategorie devizových derivátů, jak jsou definovány v tabulce 8.2 přílohy III;

v) všechny podkategorie, u kterých se má za to, že pro ně neexistuje likvidní trh pro kategorie aktiv úrokových derivátů, komoditních derivátů, úvěrových derivátů, derivátů C10 a rozdílových smluv, jak jsou definovány v tabulkách 5.3, 7.3, 9.3, 10.3 a 11.3 přílohy III;

▼M4

vi) všechny podkategorie aktiv považované za nemající likvidní trh pro kategorie derivátů povolenek na emise, jež jsou uvedeny v tabulce 13.3 přílohy III.

_____

▼B

b) ►M4 vyšší z těchto hodnot: objem obchodu, pod kterým leží procento obchodů odpovídající obchodnímu percentilu, nebo prahová hodnota pro: ◄

▼M4

_____

▼B

ii) všechny podkategorie s likvidním trhem pro kategorie aktiv úrokových derivátů, komoditních derivátů, úvěrových derivátů, derivátů C10 a rozdílových smluv, jak jsou definovány v tabulkách 5.2, 7.2, 9.2, 10.2 a 11.2 přílohy III;

▼M4

iii) všechny podkategorie aktiv s likvidním trhem pro kategorie aktiv derivátů povolenek na emise, jež jsou uvedeny v tabulce 13.2 přílohy III;

_____

▼B

3. Pro určení konkrétního objemu pro daný finanční nástroj uvedeného v čl. 8 odst. 1 písm. c) a obchodů velkého rozsahu v porovnání s běžným tržním objemem uvedených v čl. 8 odst. 1 písm. a) se použijí tyto metodiky:

a) prahová hodnota pro:

▼M4

_____

▼B

ii) kategorii aktiv sekuritizovaných derivátů, jak jsou definovány v tabulce 4.2 přílohy III;

iii) všechny podkategorie akciových derivátů, jak jsou definovány v tabulkách 6.2 a 6.3 přílohy III;

iv) všechny podkategorie devizových derivátů, jak jsou definovány v tabulce 8.2 přílohy III;

v) všechny podkategorie, u kterých se má za to, že pro ně neexistuje likvidní trh pro kategorie aktiv úrokových derivátů, komoditních derivátů, úvěrových derivátů, derivátů C10 a rozdílových smluv, jak jsou definovány v tabulkách 5.3, 7.3, 9.3, 10.3 a 11.3 přílohy III;

▼M4

vi) všechny podkategorie aktiv považované za nemající likvidní trh pro kategorii aktiv derivátů povolenek na emise, jež jsou uvedeny v tabulce 13.3 přílohy III;

_____

_____

▼B

c) nejvyšší z těchto hodnot: objem obchodu, pod kterým leží procento obchodů odpovídající obchodnímu percentilu, objem obchodu, pod kterým leží procento objemu odpovídající objemovému percentilu, nebo prahová hodnota pro všechny podkategorie aktiv, u kterých se má za to, že pro ně existuje likvidní trh pro kategorie aktiv úrokových derivátů, komoditních derivátů, úvěrových derivátů, derivátů C10 a rozdílových smluv, jak je stanoveno v tabulkách 5.2, 7.2, 9.2, 10.2 a 11.2 přílohy III;

▼M4

d) vyšší z těchto hodnot: objem obchodu, pod kterým leží procento obchodů odpovídající obchodnímu percentilu, nebo prahová hodnota pro všechny podkategorie aktiv považované za mající likvidní trh pro deriváty povolenek na emise, jak je stanoveno v tabulce 13.2 přílohy III;

▼B

4. Pro účely odst. 3 písm. c) v případě, že objem obchodu odpovídající objemovému percentilu pro určení obchodu velkého rozsahu v porovnání s běžným tržním objemem je vyšší než 97,5 obchodního percentilu, nebude objem obchodu zohledněn, a konkrétní objem pro daný finanční nástroj uvedený v čl. 8 odst. 1 písm. c) a objem obchodů velkého rozsahu v porovnání s běžným tržním objemem uvedený v čl. 8 odst. 1 písm. a) se určí jako vyšší z těchto hodnot: objem obchodu, pod kterým leží procento obchodů odpovídající obchodnímu percentilu, nebo prahová hodnota.

▼B

5. V souladu s nařízeními v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 a (EU) 2017/577 příslušné orgány shromažďují denně údaje z obchodních systémů, schválených systémů pro uveřejňování informací a od poskytovatelů konsolidovaných obchodních informací, které jsou nezbytné k provedení výpočtů pro určení:

a) finančních nástrojů a kategorií finančních nástrojů bez likvidního trhu, jak je stanoveno v odstavci 1;

▼M4

b) objemů velkého rozsahu v porovnání s běžným tržním objemem a konkrétního objemu pro daný nástroj, jak je stanoveno v odstavci 3.

▼M3

Údaje uvedené v prvním pododstavci se shromažďují v souladu s přílohou V.

▼B

6. Příslušné orgány provádějící výpočty pro kategorii finančních nástrojů mezi sebou uzavřou dohody o spolupráci, aby bylo zajištěno shromáždění údajů nezbytných pro provádění výpočtů v celé Unii.

▼M4

7. Pro účely odst. 1 písm. b), odst. 2 písm. b) a odst. 3 písm. c) a d) příslušné orgány zohlední obchody provedené v Unii v období od 1. ledna do 31. prosince předcházejícího roku.

8. Objem obchodu pro účely odst. 2 písm. b) a odst. 3 písm. c) a d) se určí na základě míry objemu, jak je stanoveno v tabulce 4 přílohy II. Je-li objem obchodu stanovený pro účely odstavců 2 a 3 vyjádřen v peněžní hodnotě a finanční nástroj není denominován v eurech, objem obchodu se převede na měnu, ve které je tento finanční nástroj denominován, a to s použitím referenčního směnného kurzu eura Evropské centrální banky platného k 31. prosinci předcházejícího roku.

▼B

9. Organizátoři trhu a investiční podniky provozující obchodní systém mohou převést objemy obchodů určené v souladu s odstavci 2 a 3 na odpovídající počet šarží předem definovaných daným obchodním systémem pro danou podkategorii či podkategorii aktiv. Organizátoři trhu a investiční podniky provozující obchodní systém mohou zachovat tyto objemy obchodů až do uplatnění výsledků příštích výpočtů provedených v souladu s odstavcem 17.

▼M4

_____

11. Pro účely určení objemů uvedených v odstavcích 2 a 3 se odst. 2 písm. b) a odst. 3 písm. c) a d) nepoužijí v případě, že je počet obchodů zahrnovaných do výpočtů menší než 1 000. V těchto případech se místo toho použijí prahové hodnoty stanovené v odst. 2 písm. a) a odst. 3 písm. a).

▼B

12. ►M4 S výjimkou odkazů na deriváty povolenek na emise se výpočty uvedené v odst. 2 písm. b) a odst. 3 písm. c) zaokrouhlují nahoru na: ◄

a) 100 000, pokud je prahová hodnota nižší než 1 milion;

b) 500 000, pokud je prahová hodnota rovna nebo vyšší než 1 milion, ale nižší než 10 milionů;

c) 5 milionů, pokud je prahová hodnota rovna nebo vyšší než 10 milionů, ale nižší než 100 milionů;

d) 25 milionů, pokud je prahová hodnota rovna nebo vyšší než 100 milionů.

13. Pro účely odstavce 1 se kvantitativní kritéria likvidity specifikovaná pro každou kategorii aktiv v příloze III určí podle oddílu 1 přílohy III.

▼M4

14. Pro akciové deriváty, které jsou přijaty k obchodování nebo poprvé obchodovány v obchodním systému, které nepatří do podkategorie, pro kterou byl uveřejněn konkrétní objem pro daný finanční nástroj uvedený v čl. 8 odst. 1 písm. c) a velikost pokynů a obchody velkého rozsahu v porovnání s běžným tržním objemem uvedené v článku 3 a čl. 8 odst. 1 písm. a), a které patří do jedné z podkategorií aktiv stanovených v odst. 1 písm. a) bodě ii), jsou konkrétní objem pro daný finanční nástroj, velikost pokynů a obchody velkého rozsahu v porovnání s běžným tržním objemem ty, které se vztahují na nejnižší průměrnou denní pomyslnou hodnotu podkategorie, do které akciový derivát patří.

15. Finanční nástroje přijaté k obchodování nebo poprvé obchodované v obchodním systému, které nepatří do žádné z podkategorií, pro které byl uveřejněn konkrétní objem pro daný finanční nástroj uvedený v čl. 8 odst. 1 písm. c) a velikost pokynů a obchody velkého rozsahu v porovnání s běžným tržním objemem uvedené v článku 3 a čl. 8 odst. 1 písm. a), se považují za nástroje nemající likvidní trh do doby, než se použijí výsledky výpočtů provedených v souladu s článkem 17. Konkrétní objem pro daný finanční nástroj uvedený v čl. 8 odst. 1 písm. c), velikost pokynů a obchody velkého rozsahu v porovnání s běžným tržním objemem uvedené v článku 3 a čl. 8 odst. 1 písm. a) jsou ty, které se vztahují na podkategorie určené jako nemající likvidní trh patřící do stejné podkategorie aktiv.

▼B

16. Po ukončení obchodního dne, ale před koncem daného dne, předloží obchodní systémy příslušným orgánům podrobnosti uvedené v příloze IV pro provádění výpočtů uvedených v odstavci 5 vždy, když je finanční nástroj přijat k obchodování nebo poprvé obchodován v tomto obchodním systému nebo vždy, když dojde ke změně dříve poskytnutých podrobností.

▼M3

17. Příslušné orgány zajistí uveřejnění výsledků výpočtů uvedených v odstavci 5 pro každý finanční nástroj a kategorii finančních nástrojů do 30. dubna následujícího roku po vstupu nařízení (EU) č. 600/2014 v použitelnost a do 30. dubna každý rok poté. Výsledky výpočtů se použijí od prvního pondělí měsíce června každého roku po uveřejnění až do dne předcházejícího prvnímu pondělí měsíce června následujícího roku.

▼M4

_____

▼B

Článek 14

Obchody, na které se vztahuje výjimka podle čl. 1 odst. 6 nařízení (EU) č. 600/2014

(čl. 1 odst. 6 nařízení (EU) č. 600/2014)

Má se za to, že obchod je uzavřen členem Evropského systému centrálních bank (ESCB) při výkonu měnové politiky, politiky směnných kurzů a politiky finanční stability, pokud takovýto obchod splňuje některý z těchto požadavků:

a) obchod je realizován za účelem výkonu měnové politiky včetně obchodu realizovaného v souladu s články 18 a 20 statutu Evropského systému centrálních bank a Evropské centrální banky, který je přílohou Smlouvy o Evropské unii, nebo operace realizované podle odpovídajících vnitrostátních ustanovení platných pro členy ESCB v členských státech, jejichž měnou není euro;

b) jedná se o devizovou operaci včetně operací realizovaných za účelem držení či správy oficiálních devizových rezerv členských států nebo služby správy rezerv poskytované členem ESCB centrálním bankám v jiných zemích, na které byla výjimka rozšířena v souladu s čl. 1 odst. 9 nařízení (EU) č. 600/2014;

c) obchod je realizován za účelem výkonu politiky finanční stability.

Článek 15

Obchody, na které se nevztahuje výjimka podle čl. 1 odst. 6 nařízení (EU) č. 600/2014

(čl. 1 odst. 7 nařízení (EU) č. 600/2014)

Ustanovení čl. 1 odst. 6 nařízení (EU) č. 600/2014 neplatí pro tyto druhy obchodů uzavřených členem ESCB k provedení investiční operace, která nemá souvislost s výkonem jednoho z úkolů uvedených v článku 14 tímto členem:

a) obchody uzavřené pro správu vlastních prostředků;

▼B

b) obchody uzavřené pro administrativní účely nebo pracovníky člena ESCB včetně obchodů prováděných správcem důchodového systému pro své zaměstnance;

c) obchody uzavřené pro vlastní investiční portfolio na základě povinností stanovených vnitrostátními právními předpisy.

▼M4

Článek 16

Dočasné pozastavení povinností týkajících se transparentnosti

(čl. 9 odst. 4 nařízení (EU) č. 600/2014)

1. Příslušné orgány mohou dočasně pozastavit povinnosti stanovené v článcích 8, 8a a 10 nařízení (EU) č. 600/2014 pro finanční nástroje, pro které existuje likvidní trh, určené na základě metodiky stanovené v článku 6a pro dluhopisy, strukturované finanční produkty a povolenky na emise a v článku 13 pro deriváty v případě, že pro kategorii dluhopisů, strukturovaných finančních produktů, povolenek na emise či derivátů celkový objem uvedený v tabulce 4 přílohy II vypočítaný za předcházejících 30 kalendářních dní představuje méně než 40 % průměrného měsíčního objemu vypočítaného za 12 celých kalendářních měsíců předcházejících těmto 30 kalendářním dnům.

2. Příslušné orgány mohou dočasně pozastavit povinnosti stanovené v článcích 8, 8a a 10 nařízení (EU) č. 600/2014 pro finanční nástroje, pro které neexistuje likvidní trh, určené na základě metodiky stanovené v článku 6a pro dluhopisy, strukturované finanční produkty a povolenky na emise a v článku 13 pro deriváty v případě, že pro kategorii dluhopisů, strukturovaných finančních produktů, povolenek na emise či derivátů celkový objem uvedený v tabulce 4 přílohy II vypočítaný za předcházejících 30 kalendářních dní představuje méně než 20 % průměrného měsíčního objemu vypočítaného za 12 celých kalendářních měsíců předcházejících těmto 30 kalendářním dnům.

3. Při provádění výpočtů uvedených v odstavcích 1 a 2 zohlední příslušné orgány obchody provedené ve všech systémech v Unii pro kategorii dotčených dluhopisů, strukturovaných finančních produktů, povolenek na emise či derivátů. Příslušné orgány provádějí tyto výpočty na úrovni kategorie finančních nástrojů, na které se vztahuje zkouška likvidity stanovená v článku 6a pro dluhopisy, strukturované finanční produkty a povolenky na emise a v článku 13 pro deriváty.

4. Před tím, než příslušné orgány pozastaví povinnosti týkajících se transparentnosti, ověří, že významný pokles likvidity napříč všemi systémy není výsledkem sezonních vlivů příslušné kategorie finančních nástrojů na likviditu.

▼B

Článek 19

Vstup v platnost a použitelnost

Toto nařízení vstupuje v platnost dvacátým dnem po vyhlášení v *Úředním věstníku Evropské unie*.

Použije se ode dne 3. ledna 2018. Článek 18 se však použije ode dne vstupu tohoto nařízení v platnost.

Toto nařízení je závazné v celém rozsahu a přímo použitelné ve všech členských státech.

▼**M4**

PŘÍLOHA I

Druhy systému a související informace určené k uveřejnění podle článku 2

Druh systému	Informace určené k uveřejnění
Systém obchodování formou průběžné aukce na základě knihy objednávek	Pro každý finanční nástroj celkový počet pokynů a objem, který představují, v každé cenové hladině, a to nejméně pro pět nejlepších nabídkových a poptávkových cen.
Systém obchodování formou periodických aukcí	Pro každý finanční nástroj cena, která by v systému obchodování formou aukce byla nejvíce v souladu s jeho obchodním algoritmem, a objem, který by byl za tuto cenu potenciálně realizovatelný účastníky tohoto systému.

▼B

PŘÍLOHA II

Bližší údaje o obchodech určené k uveřejnění

Tabulka 1

Tabulka symbolů pro tabulku 2

SYMBOL	TYP DAT	DEFINICE
{ALPHANUM-n}	Až n alfanumerických znaků	Volný text
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerické znaky	Kód měny ze tří písmen podle kódů měn ISO 4217
{DATE_TIME_FORMAT}	Formát data a času podle ISO 8601	Datum a čas v následujícím formátu: RRRR-MM-DDThh:mm:ss.dddddd Z. kde: — „RRRR“ představuje rok, — „MM“ představuje měsíc, — „DD“ představuje den, — „T“ znamená, že se má použít písmeno „T“ (time/čas), — „hh“ představuje hodinu, — „mm“ představuje minutu; — „ss.dddddd“ představuje sekundu a zlomek sekundy, — Z je čas UTC (koordinovaný světový čas). Data a časy se uvádějí v UTC.
{DECIMAL-n/m}	Celkem až n-místné desetinné číslo, z čehož až m míst může být zlomková část	Numerické pole pro kladné i záporné hodnoty: — desetinný oddělovač je „.“ (tečka), — před zápornými čísly je znaménko „–“ (minus). Hodnoty se případně zaokrouhlují, nikoli zkracují.
{ISIN}	12 alfanumerických znaků	Kód ISIN ve smyslu normy ISO 6166
{MIC}	4 alfanumerické znaky	Identifikační kód trhu ve smyslu normy ISO 10383

▼M4

Tabulka 2

Seznam údajů pro účely poobchodní transparentnosti

Uveřejněné názvy polí (záhlaví sloupců) musí být totožné s identifikátorem pole uvedeným v tabulce 2

Č.	Identifikátor pole	Finanční nástroje	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 1
1	Datum a čas obchodování	Pro všechny finanční nástroje	Datum a čas, kdy byl obchod proveden. Pro obchody provedené v obchodním systému musí být míra podrobnosti v souladu s požadavky stanovenými v článku 12 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2025/1155 ([1]). V případě obchodů, které nejsou provedeny v obchodním systému, datum a čas dohody stran na obsahu těchto polí: množství, cena, měny, jak jsou stanoveny v polích 31, 34 a 44 v tabulce 2 přílohy I nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, identifikační kód nástroje, klasifikace nástroje a popřípadě kód podkladového nástroje. V případě obchodů, které nejsou provedeny v obchodním systému, se čas uvádí s přesností alespoň na nejbližší sekundu. Pokud je obchod výsledkem pokynu předaného provádějícím podnikem jménem zákazníka třetí straně a pokud nebyly splněny podmínky pro předávání stanovené v článku 4 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, uvádí se datum a čas obchodu, nikoli čas předání pokynu.	Regulovaný trh (RM) Mnohostranný obchodní systém (MTF), organizovaný obchodní systém (OTF) Schválený systém pro uveřejňování informací (APA)	{DATE_TIME_FORMAT}
2	Identifikační kód nástroje	Pro všechny finanční nástroje	Kód k identifikaci finančního nástroje.	RM, MTF, OTF, APA	{ISIN}

▼M4

Č.	Identifikátor pole	Finanční nástroje	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 1
3	Cena	Pro všechny finanční nástroje	Obchodovaná cena bez případné provize a vzniklého úroku. Obchodovaná cena se vykazuje v souladu se standardní tržní konvencí. Hodnota uvedená v tomto poli musí být v souladu s hodnotou uvedenou v poli „Cenová notace“. Pokud cena není v současnosti k dispozici, ale čeká se na její uvedení („PNDG“), nebo pokud není relevantní („NOAP“), pole se nevyplňuje.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/13}, pokud je cena vyjádřena peněžní hodnotou {DECIMAL-11/10}, pokud je cena vyjádřena procentním podílem nebo výnosem {DECIMAL-18/17}, pokud je cena vyjádřena v bazických bodech
4	Chybějící cena	Pro všechny finanční nástroje	Pokud cena není v současnosti k dispozici, ale čeká se na její uvedení, vyplní se do tohoto pole „PNDG“. Není-li cena relevantní, vyplní se „NOAP“.	RM, MTF, OTF, APA	„PNDG“, pokud cena není k dispozici „NOAP“, pokud cena není relevantní
5	Měna ceny	Pro všechny finanční nástroje	Hlavní měna, v níž je cena vyjádřena (v případě, že je cena vyjádřena peněžní hodnotou).	RM, MTF, OTF, APA	{CURRENCY CODE_3}
6	Cenová notace	Pro všechny finanční nástroje	Údaj o tom, zda je cena vyjádřena jako peněžní hodnota, procentní podíl, bazické body nebo výnos. Cenová notace se uvádí v souladu se standardní tržní konvencí. U swapů úvěrového selhání se do tohoto pole vyplní „BAPO“. U dluhopisů (jiných než ETN a ETC) se toto pole vyplní procentem („PERC“) pomyslné částky. Pokud cena v procentech není standardní tržní konvencí, vyplní se „YIEL“, „BAPO“ nebo „MONE“ v souladu se standardní tržní konvencí. Hodnota uvedená v tomto poli musí být v souladu s hodnotou uvedenou v poli „Cena“. Pokud se cena oznamuje v peněžní hodnotě, uvádí se v hlavní měnové jednotce.	RM, MTF, OTF, APA	„MONE“ – peněžní hodnota „PERC“ – procento „YIEL“ – výnos „BAPO“ – bazické body

▼M4

Č.	Identifikátor pole	Finanční nástroje	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 1
			Pokud cena není v současnosti k dispozici, ale čeká se na její uvedení („PNDG“), nebo pokud není relevantní („NOAP“), pole se nevyplňuje.		
7	Množství	Pro všechny finanční nástroje s výjimkou případů popsaných v čl. 11 odst. 1 písm. a) a b) tohoto nařízení	U finančních nástrojů obchodovaných v jednotkách počet jednotek finančního nástroje. Jinak se nevyplňuje.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/17}
8	Množství v měrné jednotce	Pro smlouvy určené v jednotkách u komoditních derivátů, derivátů C10, derivátů povolenek na emise a povolenek na emise s výjimkou případů popsaných v čl. 11 odst. 1 písm. a) a b) tohoto nařízení	Odpovídající hodnota obchodovaných komodit nebo povolenek na emise vyjádřená v měrné jednotce.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/17}
9	Notace množství v měrné jednotce	Pro smlouvy určené v jednotkách u komoditních derivátů, derivátů C10, derivátů povolenek na emise a povolenek na emise s výjimkou případů popsaných v čl. 11 odst. 1 písm. a) a b) tohoto nařízení	Údaj o notaci, jíž se zapisuje množství v měrné jednotce.	RM, MTF, OTF, APA	„TOCD“ – tuny ekvivalentu oxidu uhličitého pro každou smlouvu týkající se povolenek na emise „TONE“ – metrické tuny „MWHO“ – megawatthodiny „MBTU“ – jeden milion britských tepelných jednotek „THMS“ – thermy „DAYS“ – dny nebo {ALPHANUM-4} jinak

▼M4

Č.	Identifikátor pole	Finanční nástroje	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 1
10	Pomyslná částka	Pro všechny finanční nástroje s výjimkou případů popsaných v čl. 11 odst. 1 písm. a) a b) tohoto nařízení	Toto pole se vyplní: i) u dluhopisů (s výjimkou ETC a ETN) nominální hodnotou, což je částka vyplacená investorovi při splacení; ii) u ETC a ETN a sekuritizovaných derivátů počtem nástrojů vyměněných mezi kupujícími a prodávajícími vynásobeným cenou vyměněného nástroje v rámci daného obchodu. Popřípadě údajem z pole cena vynásobeným údajem z pole množství; iii) u strukturovaných finančních produktů (SFP) nominální hodnotou na jednotku vynásobenou počtem nástrojů v době obchodu; iv) u swapů úvěrového selhání pomyslnou hodnotou, na kterou se vztahuje nabyté nebo převedené zajištění; v) u opcí, swapcí, swapů jiných než uvedených v bodě iv), futures a forwardů pomyslnou hodnotou smlouvy; vi) u povolenek na emise výsledným množstvím za příslušnou cenu stanovenou ve smlouvě v době obchodu. Popřípadě údajem z pole cena vynásobeným údajem z pole množství v měrné jednotce; vii) u sázek na rozpětí peněžní hodnotou vsazenou na pohyb bodů v podkladovém finančním nástroji v době obchodu;	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/5}

▼M4

Č.	Identifikátor pole	Finanční nástroje	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 1
			viii) u rozdílových smluv počtem nástrojů vyměněných mezi kupujícími a prodávajícími vynásobeným cenou nástroje vyměněného v rámci daného obchodu. Popřípadě údajem z pole cena vynásobeným údajem z pole množství.		
11	Jmenovitá měna	Pro všechny finanční nástroje s výjimkou případů popsaných v čl. 11 odst. 1 písm. a) a b) tohoto nařízení	Hlavní měna, v níž je denominována pomyslná částka. U měnového derivátu nebo swapu více měn nebo swapce, kde je podkladový swap víceměnový nebo měnová rozdílová smlouva nebo smlouva týkající se sázek na rozpětí, se jedná o pomyslnou měnu komponenty 1.	RM, MTF, OTF, APA	{CURRENCY CODE_3}
12	[zrušeno]				
13	Místo provedení	Pro všechny finanční nástroje	Identifikace místa, kde byl obchod proveden. Pro obchody provedené v obchodním systému EU použijte MIC tržního segmentu podle ISO 10383. Pokud MIC tržního segmentu neexistuje, použijte operační MIC. Pro finanční nástroje přijaté k obchodování nebo obchodované v obchodním systému, kde je obchod týkající se daného finančního nástroje proveden prostřednictvím systematického internalizátora, použijte „SINT“. Pokud v případě finančních nástrojů přijatých k obchodování nebo obchodovaných v obchodním systému není obchod s daným finančním nástrojem proveden v obchodním systému EU ani prostřednictvím systematického internalizátora, použijte kód MIC „XOFF“. Pokud je obchod proveden na organizované obchodní platformě mimo EU, pak je kromě „XOFF“ vyžadováno také vyplnění pole „Obchodní místo provedení ve třetí zemi“.	RM, MTF, OTF, APA	{MIC} – obchodní systémy EU nebo „SINT“ – systematický internalizátor „XOFF“ – jinak

▼M4

Č.	Identifikátor pole	Finanční nástroje	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 1
14	Obchodní místo provedení ve třetí zemi	Pro všechny finanční nástroje	Identifikace obchodního systému třetí země, kde byl obchod proveden. Použijte MIC tržního segmentu podle ISO 10383. Pokud MIC tržního segmentu neexistuje, použijte operační MIC. Pokud obchod není proveden v obchodním systému třetí země, pole se nevyplňuje.	APA	{MIC}
15	Datum a čas uveřejnění	Pro všechny finanční nástroje	Datum a čas, kdy byl obchod uveřejněn obchodním systémem nebo schváleným systémem pro uveřejňování informací. Pro obchody provedené v obchodním systému musí být míra podrobnosti v souladu s požadavky stanovenými v článku 12 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2025/1155. V případě obchodů, které nejsou provedeny v obchodním systému, se čas uvádí s přesností alespoň na nejbližší sekundu.	RM, MTF, OTF, APA	{DATE_TIME_FORMAT}
16	Místo uveřejnění	Pro všechny finanční nástroje	Kód sloužící k identifikaci obchodního systému a schváleného systému pro uveřejňování informací uveřejňujícího obchod.	RM, MTF, OTF, APA	{MIC}
17	Identifikační kód obchodu	Pro všechny finanční nástroje	Alfanumerický kód přidělený danému obchodu obchodním systémem (v souladu s článkem 12 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580 ([2])) a schváleným systémem pro uveřejňování informací, který se používá při každém dalším odkazu na daný obchod.	RM, MTF, OTF, APA	{ALFA NUMERICAL-52}
18	Obchody, které mají být předmětem clearingu	Pro deriváty	Kód určený k identifikaci toho, zda bude obchod předmětem clearingu.	RM, MTF, OTF, APA	„TRUE“ – obchod má být předmětem clearingu „FALSE“ – obchod nemá být předmětem clearingu

▼M4

Č.	Identifikátor pole	Finanční nástroje	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 1
19	Označení	Pro všechny finanční nástroje	Jedno nebo více polí by mělo být vyplněno příslušnými označeními, jak je popsáno v tabulce 3 přílohy II. Pokud nenastala žádná z uvedených okolností, měl by být obchod uveřejněn bez označení. Pokud je možná kombinace označení a jejich uvedení v jednom poli, měla by být uváděná označení oddělena čárkami.	RM, MTF, OTF, APA	Jak je stanoveno v tabulce 3 přílohy II.
20	Systém obchodování	Pro všechny finanční nástroje	Druh systému obchodování, ve kterém byla transakce provedena. Pokud je pole „Místo provedení“ vyplněno hodnotou „SINT“ nebo „XOFF“, toto pole se nevyplňuje.	RM, MTF, OTF	„CLOB“ – systém obchodování prostřednictvím centrální knihy limitních pokynů. „QDTS“ – systémy obchodování založené na kotacích, tj. systémy, při nichž se obchody uzavírají na základě pevných kotací, jež mají účastníci průběžně k dispozici, a který vyžaduje, aby tvůrci trhu udržovali kotace v objemu, jenž zachovává rovnováhu mezi potřebami členů a účastníků obchodovat v komerčních objemech a rizikem, jemuž se vystavuje sám tvůrce trhu. „PATS“ – systémy obchodování formou periodických aukcí. „RFQT“ – systémy obchodování formou žádostí o kotace, tj. systém obchodování, při němž jsou jedna nebo více kotací poskytovány na základě žádosti o kotaci předložené jedním nebo více jinými členy nebo účastníky. Tato kotace je zobchodovatelná pouze žádajícím členem nebo účastníkem trhu. Žádající člen nebo účastník může obchod uzavřít přijetím jedné nebo více kotací, které mu byly na základě žádosti poskytnuty.

▼M4

Č.	Identifikátor pole	Finanční nástroje	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 1
					„VOIC“ – systém hlasového obchodování, tj. systém obchodování, při němž jsou obchody organizovány prostřednictvím ústního jednání členů. „HYBR“ – hybridní systém obchodování, tj. systém spadající do dvou nebo více z výše uvedených druhů systémů obchodování. „OTHR“ – všechny ostatní systémy obchodování, tj. jakýkoli jiný druh systému obchodování neuvedený výše.
21	Počet obchodů	Pro veřejnoprávní dluhopisy	Toto pole by mělo být vyplněno počtem provedených obchodů, pokud je podle čl. 11 odst. 3 písm. b) nařízení (EU) č. 600/2014 požadován odklad uveřejnění podrobností o několika obchodech v souhrnné podobě.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/17}.

([1]) Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2025/1155 ze dne 12. června 2025, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014, pokud jde o regulační technické normy upřesňující vstupní a výstupní údaje konsolidovaných obchodních informací, synchronizaci obchodních hodin a přerozdělování výnosů poskytovatelem konsolidovaných obchodních informací pro akcie a fondy obchodované v obchodním systému, a kterým se zrušuje nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574 (Úř. věst. L, 2025/1155, 3.11.2025, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2025/1155/oj).

([2]) Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580 ze dne 24. června 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014, pokud jde o regulační technické normy pro uchovávání příslušných údajů o pokynech týkajících se finančních nástrojů (Úř. věst. L 87, 31.3.2017, s. 193, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/580/oj).

▼M4

Tabulka 3

Seznam označení pro účely poobchodní transparentnosti

OZNAČENÍ POOBCHODNÍHO ODKLADU PRO DERIVÁTY

Označení	Název	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Popis
„LRGS“	Označení obchodu s poobchodním odkladem z důvodu velkého rozsahu (LIS)	RM, MTF, OTF, APA	Obchody provedené v rámci poobchodního odkladu z důvodu velkého rozsahu
„ILQD“	Označení obchodu s nelikvidními finančními nástroji	RM, MTF, OTF, APA	Obchody provedené v rámci odkladu pro nástroje, pro které neexistuje likvidní trh
„SIZE“	Označení obchodu s poobchodním odkladem z důvodu konkrétního objemu pro daný nástroj (SSTI)	RM, MTF, OTF, APA	Obchody provedené v rámci poobchodního odkladu z důvodu konkrétního objemu pro daný nástroj

OZNAČENÍ POOBCHODNÍHO ODKLADU PRO DLUHOPISY (S VÝJIMKOU ETC A ETN)

Označení	Název	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Popis
MLF1	Označení obchodu středního objemu s likvidními nástroji	RM, MTF, OTF, APA	Obchody provedené s dluhopisy, u nichž se použije odklad uveřejnění vztahující se na obchody středního objemu s finančním nástrojem, pro který existuje likvidní trh v souladu s čl. 8a odst. 1 písm. a) tohoto nařízení.
MIF2	Označení obchodu středního objemu s nelikvidními nástroji	RM, MTF, OTF, APA	Obchody provedené s dluhopisy, u nichž se použije odklad uveřejnění vztahující se na obchody středního objemu s finančním nástrojem, pro který neexistuje likvidní trh v souladu s čl. 8a odst. 1 písm. b) tohoto nařízení.
LLF3	Označení obchodu velkého objemu s likvidními nástroji	RM, MTF, OTF, APA	Obchody provedené s dluhopisy, u nichž se použije odklad uveřejnění vztahující se na obchody velkého objemu s finančním nástrojem, pro který existuje likvidní trh v souladu s čl. 8a odst. 1 písm. c) tohoto nařízení.
LIF4	Označení obchodu velkého objemu s nelikvidními nástroji	RM, MTF, OTF, APA	Obchody provedené s dluhopisy, u nichž se použije odklad uveřejnění vztahující se na obchody velkého objemu s finančním nástrojem, pro který neexistuje likvidní trh v souladu s čl. 8a odst. 1 písm. d) tohoto nařízení.

▼M4

OZNAČENÍ POOBCHODNÍHO ODKLADU PRO DLUHOPISY (S VÝJIMKOU ETC A ETN)

Označení	Název	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Popis
VLF5	Označení obchodu velmi velkého objemu s likvidními nástroji	RM, MTF, OTF, APA	Obchody provedené s dluhopisy, u nichž se použije odklad uveřejnění vztahující se na obchody velmi velkého objemu s finančním nástrojem, pro který existuje likvidní trh v souladu s čl. 8a odst. 1 písm. e) tohoto nařízení.
VIF5	Označení obchodu velmi velkého objemu s nelikvidními nástroji	RM, MTF, OTF, APA	Obchody provedené s dluhopisy, u nichž se použije odklad uveřejnění vztahující se na obchody velmi velkého objemu s finančním nástrojem, pro který neexistuje likvidní trh v souladu s čl. 8a odst. 1 písm. e) tohoto nařízení.

OZNAČENÍ POOBCHODNÍHO ODKLADU PRO ETC, ETN, SFP A POVOLENKY NA EMISE

Označení	Název	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Popis
DEFF	Odklad uveřejnění pro ETC, ETN, SFP a povolenky na emise	RM, MTF, OTF, APA	Obchody provedené s ETC, ETN, SFP a povolenkami na emise, na které se vztahuje odklad uveřejnění stanovený v čl. 8a odst. 2 a 3 tohoto nařízení.

OZNAČENÍ DODATEČNÉHO ODKLADU PRO DERIVÁTY

Čl. 11 odst. 1 písm. a) bod i)	„LMTF“	Označení omezených podrobností	RM, MTF, OTF, APA	První hlášení s uveřejněním omezených podrobností v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. a) bodem i).
	„FULF“	Označení úplných podrobností	RM, MTF, OTF, APA	Obchody, pro které byly dříve uveřejněny omezené podrobnosti v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. a) bodem i).
Čl. 11 odst. 1 písm. a) bod ii)	„DATF“	Označení denního souhrnu obchodů	RM, MTF, OTF, APA	Uveřejnění denního souhrnu obchodů v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. a) bodem ii).
	„FULA“	Označení úplných podrobností	RM, MTF, OTF, APA	Jednotlivé obchody, pro které byl dříve uveřejněn souhrn podrobností v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. a) bodem ii).

▼M4

OZNAČENÍ DODATEČNÉHO ODKLADU PRO DERIVÁTY				
Čl. 11 odst. 1 písm. b)	„VOLO“	Označení neuveřejnění údajů o objemu	RM, MTF, OTF, APA	Obchody, pro které jsou uveřejněny omezené podrobnosti v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. b).
	„FULV“	Označení úplných podrobností	RM, MTF, OTF, APA	Obchody, pro které byly dříve uveřejněny omezené podrobnosti v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. b).
Čl. 11 odst. 1 písm. c)	„FWAF“	Označení čtyřtýdenního souhrnu	RM, MTF, OTF, APA	Uveřejnění souhrnu obchodů v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. c).
	„FULJ“	Označení úplných podrobností	RM, MTF, OTF, APA	Jednotlivé obchody, pro které byl dříve uveřejněn souhrn údajů v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. c).

OZNAČENÍ DODATEČNÉHO ODKLADU PRO STÁTNÍ DLUHOPISY				
Čl. 11 odst. 3 písm. a)	„OMIS“	Označení neuveřejnění údajů o objemu	RM, MTF, OTF, APA	Obchody, pro které jsou uveřejněny omezené podrobnosti v souladu s čl. 11 odst. 3 písm. a) nařízení (EU) č. 600/2014.
	„FULO“	Označení úplných podrobností	RM, MTF, OTF, APA	Obchody, pro které byly dříve uveřejněny omezené podrobnosti v souladu s čl. 11 odst. 3 písm. a) nařízení (EU) č. 600/2014.
Čl. 11 odst. 3 písm. b)	„AGFW“	Označení čtyřtýdenního souhrnu	RM, MTF, OTF, APA	Uveřejnění souhrnu obchodů v souladu s čl. 11 odst. 3 písm. b) nařízení (EU) č. 600/2014.
	„FULG“	Označení úplných podrobností	RM, MTF, OTF, APA	Jednotlivé obchody, pro které byl dříve uveřejněn souhrn údajů v souladu s čl. 11 odst. 3 písm. b) nařízení (EU) č. 600/2014.

OSTATNÍ OZNAČENÍ

Označení	Název	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Popis
„BENC“	Označení referenčního obchodu	RM, MTF, OTF, APA	Obchody provedené s odkazem na cenu, která je vypočtena ve více okamžicích na základě dané referenční hodnoty, jako je například průměrná cena vážená objemem nebo průměrná cena vážená časem.
„NPFT“	Označení obchodů, při nichž se netvoří ceny	RM, MTF, OTF, APA	Obchody, při nichž se netvoří ceny, podle čl. 2 odst. 5 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590.

▼M4

OSTATNÍ OZNAČENÍ

Označení	Název	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Popis
„TPAC“	Označení souborného obchodu	RM, MTF, OTF, APA	Souborné obchody, které nepředstavují výměnu za hmotná aktiva, ve smyslu čl. 2 odst. 1 bodu 50 písm. b) nařízení (EU) č. 600/2014.
„XFPH“	Označení obchodu představujícího výměnu za hmotná aktiva	RM, MTF, OTF, APA	Výměna za hmotná aktiva ve smyslu čl. 2 odst. 1 bodu 48 nařízení (EU) č. 600/2014.
„CANC“	Označení zrušeného obchodu	RM, MTF, OTF, APA	Je-li dříve uveřejněný obchod zrušen.
„AMND“	Označení změny	RM, MTF, OTF, APA	Je-li dříve uveřejněný obchod změněn.
„PORT“	Označení portfoliového obchodu	RM, MTF, OTF, APA	Obchod s pěti nebo více různými finančními nástroji, pokud jsou tyto obchody realizovány ve stejnou dobu stejným klientem a za jednu souhrnnou cenu a nejedná se o „souborný obchod“ ve smyslu čl. 2 odst. 1 bodu 50 nařízení (EU) č. 600/2014.
„MTCH“	Označení obchodování párováním pokynů na vlastní účet	OTF	Obchodování párováním pokynů na vlastní účet uvedené v čl. 4 odst. 1 bodě 38 směrnice 2014/65/EU.
„NEGO“	Označení sjednaného obchodu	RM, MTF, OTF	Obchody, které jsou sjednány soukromě, ale jsou hlášeny podle pravidel obchodního systému.

▼M3

Tabulka 4

Míra objemu

Druh nástroje	Objem
Všechny dluhopisy s výjimkou ETC a ETN a strukturovaných finančních produktů	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Druhy dluhopisů ETC a ETN	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Sekuritizované deriváty	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Úrokové deriváty	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Měnové deriváty	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Akciové deriváty	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Komoditní deriváty	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Úvěrové deriváty	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Rozdílové smlouvy	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Deriváty C10	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Deriváty povolenek na emise	„Množství v měrné jednotce“ podle pole 8 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Povolenky na emise	„Množství v měrné jednotce“ podle pole 8 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.

▼B

PŘÍLOHA III

Posouzení likvidity, prahové hodnoty LIS a SSTI pro nekapitálové finanční nástroje

▼M4

1. **Pokyny pro účely této přílohy**

1. Odkaz na nesplacený objem emise dluhopisů v tabulce 2.2 se týká celkové hodnoty dluhopisů, které byly vydány a které jsou v současné době v držení investorů.

2. Odkazem na „kategorii aktiv“ se rozumí odkaz na tyto kategorie finančních nástrojů: dluhopisy, strukturované finanční produkty, sekuritizované deriváty, úrokové deriváty, akciové deriváty, komoditní deriváty, měnové deriváty, úvěrové deriváty, deriváty C10, rozdílové smlouvy, povolenky na emise a deriváty povolenek na emise.

3. Odkazem na „podkategorii aktiv“ se rozumí odkaz na kategorii aktiv segmentovanou na podrobnější míru rozčlenění na základě typu smlouvy a/nebo druhu podkladového nástroje.

4. Odkazem na „podkategorii“ se rozumí odkaz na podkategorii aktiv segmentovanou na podrobnější míru rozčlenění na základě dalších kvalitativních kritérií pro segmentaci, jak je uvedeno v tabulkách 2.2 až 13.3 této přílohy.

5. „Průměrnou denní pomyslnou částkou (ADNA)“ se rozumí celková pomyslná částka pro konkrétní finanční nástroj stanovená podle míry objemu uvedené v tabulce 4 přílohy II a provedená v období stanoveném v čl. 13 odst. 7, vydělená počtem obchodních dní v daném období nebo případně v dané části roku, během níž byl finanční nástroj přijat k obchodování nebo obchodován v obchodním systému a obchodování nebylo pozastaveno.

6. „Průměrným denním počtem obchodů“ se rozumí celkový počet obchodů provedených pro konkrétní finanční nástroj v období stanoveném v čl. 13 odst. 7, vydělený počtem obchodních dní v daném období nebo případně v dané části roku, během níž byl finanční nástroj přijat k obchodování nebo obchodován v obchodním systému a obchodování nebylo pozastaveno.

7. „Futures“ se rozumí smlouva o koupi nebo prodeji komodity nebo finančního nástroje k určenému budoucímu datu za cenu sjednanou kupujícím a prodávajícím při zahájení smlouvy. Všechny futures mají standardní podmínky určující minimální množství a kvalitu, která může být nakoupena či prodána, nejnižší částku, o niž lze změnit cenu, postupy pro vypořádání, datum splatnosti a další charakteristiky související s danou smlouvou.

8. „Opcí“ se rozumí smlouva, která dává vlastníkovi právo, ale nikoli povinnost koupit (opce k prodeji) nebo prodat (opce k nákupu) určitý finanční nástroj nebo komoditu za předem stanovenou cenu nebo realizační cenu, a to k určitému budoucímu datu nebo datu realizace nebo do určitého budoucího data nebo data realizace.

9. „Swapem“ se rozumí smlouva, v níž se dvě strany dohodnou k určitému budoucímu datu vyměnit peněžní toky v jednom finančním nástroji za peněžní toky v jiném finančním nástroji.

10. „Portfoliovým swapem“ se rozumí smlouva, jejímž prostřednictvím mohou koncoví uživatelé obchodovat s vícenásobnými swapy.

▼**M4**

11. „Forwardem“ se rozumí soukromá dohoda mezi dvěma stranami o koupi nebo prodeji komodity nebo finančního nástroje k určenému budoucímu datu za cenu sjednanou kupujícím a prodávajícím při zahájení smlouvy.

12. „Swapcí“ nebo „opcí na swap“ se rozumí smlouva, která dává vlastníkovi právo, ale nikoli povinnost vstoupit k určitému budoucímu datu nebo datu realizace nebo do určitého budoucího data nebo data realizace do swapu.

13. „Futures na swap“ se rozumí futures, které dávají vlastníkovi povinnost vstoupit k určitému budoucímu datu nebo do určitého budoucího data do swapu.

14. „Forwardem na swap“ se rozumí forward, který dává vlastníkovi povinnost vstoupit k určitému budoucímu datu nebo do určitého budoucího data do swapu.

▼M4

2. **Dluhopisy**

Tabulka 2.2

Dluhopisy (všechny druhy dluhopisů s výjimkou ETC a ETN) – kategorie nemající likvidní trh

Každý jednotlivý dluhopis se určí jako nemající likvidní trh podle čl. 6a, pokud je charakterizován specifickou kombinací charakteristik dluhopisu, jak jsou uvedeny v jednotlivých řádcích tabulek níže.

Státní a jiné veřejné dluhopisy						
Identifikační kód skupiny	**Identifikační kód MiFIR**	**Druh dluhopisu**	**Emitent nebo země emitenta**	**Zbytková splatnost**	**Druh kupónu**	**Nesplacený objem emise**
	RTS2#3	RTS2#9	Země emitenta vykázaná v poli nařízení Komise v přenesené pravomoci 2017/585 ([1]) („RTS23“) „Identifikátor emitenta nebo provozovatele obchodního systému“	Doba zbývající do data splatnosti vykázaného v poli RTS23 „Datum splatnosti“	Třetí písmeno kódu CFI vykázaného v poli RTS23 „Klasifikace nástroje“	Pole RTS23 „Celková nominální hodnota emise“ převedeno na EUR
G1	BOND	EUSB Dluhopisem EUSB se rozumí dluhopis, který není konvertibilní ani krytý a vydal jej veřejnoprávní emitent: a) Unie; b) členský stát, včetně jakéhokoli ministerstva, vládní organizace nebo zvláštní účelové jednotky členského státu; c) v případě federativního členského státu člen federace; d) zvláštní účelová jednotka pro několik členských států; e) mezinárodní finanční instituce zřízená dvěma nebo více členskými státy, jejímž účelem je získávat finanční prostředky a poskytovat finanční pomoc ve prospěch svých členů, kteří jsou postiženi nebo ohroženi vážnými finančními problémy; f) Evropská investiční banka; g) svrchovaný subjekt třetí země.	Zemí emitenta je členský stát, Spojené státy americké nebo Spojené království NEBO emitentem je Unie.	Do 10 let včetně	F (pevný kupón)	Méně než 5 000 000 000 EUR
G2	BOND	EUSB nebo OEPB Dluhopisem OEPB se rozumí dluhopis, který není konvertibilní ani krytý a vydal jej veřejný subjekt, který není veřejnoprávním emitentem.	Jakýkoli nástroj, který nepatří do kategorie G1			Méně než 1 000 000 000 EUR

([1]) Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/585 ze dne 14. července 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014, pokud jde o regulační technické normy pro standardy a formáty referenčních údajů o finančním nástroji a technická opatření ve vztahu k mechanismům, které mají Evropský orgán pro cenné papíry a trhy a příslušné orgány vytvořit (Úř. věst. L 87, 31.3.2017, s. 368, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/585/oj).

▼M4

Podnikové, konvertibilní a jiné dluhopisy					
Identifikační kód skupiny	**Identifikační kód MiFIR**	**Druh dluhopisu**	**Měna**	**Úvěrové hodnocení**	**Nesplacený objem emise**
	RTS2#3	RTS2#9	Měna nástroje vykázaná v poli RTS23 „Jmenovitá měna 1“		Pole RTS23 „Celková nominální hodnota emise“ převedeno na EUR
G3	BOND	CRPB, CVTB nebo OTHR Dluhopisem CRPB se rozumí dluhopis, který není konvertibilní ani krytý a je vydán evropskou akciovou společností (Societas Europaea) zřízenou v souladu s nařízením Rady (ES) č. 2157/2001 ([1]) nebo některou z forem společností uvedených v příloze I nebo II směrnice Evropského parlamentu a Rady 2013/34/EU ([2]) nebo jejich ekvivalentem ve třetích zemích. Dluhopisem CVTB se rozumí nástroj sestávající z dluhopisu nebo sekuritizovaného dluhového nástroje s vloženým derivátem, jako například opce na koupi podkladového kapitálu.	EUR, GBP, USD	Investiční stupeň	Méně než 500 000 000 EUR
G4	BOND	CRPB, CVTB nebo OTHR	Jakýkoli nástroj, který nepatří do kategorie G3		Méně než 500 000 000 EUR

([1]) Nařízení Rady (ES) č. 2157/2001 ze dne 8. října 2001 o statutu evropské společnosti (SE) (Úř. věst. L 294, 10.11.2001, s. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2001/2157/oj).
([2]) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2013/34/EU ze dne 26. června 2013 o ročních účetních závěrkách, konsolidovaných účetních závěrkách a souvisejících zprávách některých forem podniků, o změně směrnice Evropského parlamentu a Rady 2006/43/ES a o zrušení směrnic Rady 78/660/EHS a 83/349/EHS (Úř. věst. L 182, 29.6.2013, s. 19, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2013/34/oj).

Kryté dluhopisy			
Identifikační kód skupiny	**Identifikační kód MiFIR**	**Druh dluhopisu**	**Nesplacený objem emise**
	RTS2#3	RTS2#9	Pole RTS23 „Celková nominální hodnota emise“ převedeno na EUR
G5	BOND	CVDB Dluhopisem CVDB se rozumí dluhopisy uvedené v čl. 52 odst. 4 směrnice Evropského parlamentu a Rady 2009/65/ES ([1]).	Méně než 500 000 000 EUR

([1]) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2009/65/ES ze dne 13. července 2009 o koordinaci právních a správních předpisů týkajících se subjektů kolektivního investování do převoditelných cenných papírů (SKIPCP) (Úř. věst. L 302, 17.11.2009, s. 32, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2009/65/oj).

▼M4

Tabulka 2.3

Dluhopisy (všechny druhy dluhopisů s výjimkou ETC a ETN) – předobchodní prahové hodnoty LIS

Kategorie aktiv – dluhopisy (všechny druhy dluhopisů s výjimkou ETC a ETN)	
Druh dluhopisu	**Předobchodní LIS**
Státní dluhopis a jiný veřejný dluhopis	5 000 000 EUR
Podnikový dluhopis, konvertibilní dluhopis a jiný dluhopis	1 000 000 EUR
Krytý dluhopis	5 000 000 EUR

Tabulka 2.4

Dluhopisy (druhy dluhopisů ETC a ETN) – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – dluhopisy (druhy dluhopisů ETC a ETN)	
Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6a se použije následující metodika:	
Komodity obchodované v obchodním systému (ETC) – RTS2#3 = ETCS: dluhový nástroj vydaný emitentem proti přímé investici v komoditách nebo komoditních derivátech. Cena ETC je přímo nebo nepřímo závislá na vývoji podkladového nástroje. ETC pasivně sleduje vývoj komodity nebo indexů komodit, ke kterým se vztahuje.	Všechny ETC se považují za nemající likvidní trh.
Dluhové cenné papíry obchodované v obchodním systému (ETN) – RTS2#3 = ETNS: dluhový nástroj vydaný emitentem proti přímé investici v podkladových nástrojích nebo podkladových derivátech. Cena ETN je přímo nebo nepřímo závislá na vývoji podkladového nástroje. ETN pasivně sleduje vývoj podkladového nástroje, ke kterému se vztahuje.	Všechny ETN se považují za nemající likvidní trh.

Tabulka 2.5

Dluhopisy (druhy dluhopisů ETC a ETN) – předobchodní prahová hodnota LIS

Kategorie aktiv – dluhopisy (druhy dluhopisů ETC a ETN)	
Druh dluhopisu	**Předobchodní LIS**
ETC	1 000 000 EUR
ETN	1 000 000 EUR

▼M4

Tabulka 2.6

Dluhopisy (všechny druhů dluhopisů s výjimkou ETC a ETN) – režim odkladu

Kategorie aktiv – dluhopisy (všechny druhy dluhopisů s výjimkou ETC a ETN)			
Druh dluhopisu	**Kategorie**	**Likvidita**	**Objem (větší nebo rovný)**
Státní dluhopis v kategorii G1 podle tabulky 2.2	1	Považuje se za mající likvidní trh	15 000 000 EUR
	2	Považuje se za nemající likvidní trh	5 000 000 EUR
	3	Považuje se za mající likvidní trh	50 000 000 EUR
	4	Považuje se za nemající likvidní trh	15 000 000 EUR
	5	Považuje se za mající likvidní trh	100 000 000 EUR
	5	Považuje se za nemající likvidní trh	50 000 000 EUR
Státní dluhopis a jiný veřejný dluhopis v kategorii G2 podle tabulky 2.2	1	Považuje se za mající likvidní trh	10 000 000 EUR
	2	Považuje se za nemající likvidní trh	1 000 000 EUR
	3	Považuje se za mající likvidní trh	20 000 000 EUR
	4	Považuje se za nemající likvidní trh	2 000 000 EUR
	5	Považuje se za mající likvidní trh	50 000 000 EUR
	5	Považuje se za nemající likvidní trh	5 000 000 EUR
Podnikový dluhopis, konvertibilní dluhopis a jiný dluhopis v kategorii G3 podle tabulky 2.2	1	Považuje se za mající likvidní trh	1 500 000 EUR
	2	Považuje se za nemající likvidní trh	500 000 EUR
	3	Považuje se za mající likvidní trh	7 500 000 EUR
	4	Považuje se za nemající likvidní trh	2 000 000 EUR
	5	Považuje se za mající likvidní trh	15 000 000 EUR
	5	Považuje se za nemající likvidní trh	5 000 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – dluhopisy (všechny druhy dluhopisů s výjimkou ETC a ETN)			
Druh dluhopisu	**Kategorie**	**Likvidita**	**Objem (větší nebo rovný)**
Podnikový dluhopis, konvertibilní dluhopis a jiný dluhopis v kategorii G4 podle tabulky 2.2	1	Považuje se za mající likvidní trh	1 000 000 EUR
	2	Považuje se za nemající likvidní trh	500 000 EUR
	3	Považuje se za mající likvidní trh	5 000 000 EUR
	4	Považuje se za nemající likvidní trh	2 000 000 EUR
	5	Považuje se za mající likvidní trh	10 000 000 EUR
	5	Považuje se za nemající likvidní trh	5 000 000 EUR
Kryté dluhopisy v kategorii G5 podle tabulky 2.2	1	Považují se za mající likvidní trh	5 000 000 EUR
	2	Považují se za nemající likvidní trh	1 000 000 EUR
	3	Považují se za mající likvidní trh	20 000 000 EUR
	4	Považují se za nemající likvidní trh	5 000 000 EUR
	5	Považují se za mající likvidní trh	50 000 000 EUR
	5	Považují se za nemající likvidní trh	10 000 000 EUR

3. **Strukturované finanční produkty (SFP)**

Tabulka 3.1

SFP – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – strukturované finanční produkty (SFP)
Posouzení kategorie aktiv SFP pro účely určení finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6a – RTS2#3 = SFPS
Všechny SFP se považují za nemající likvidní trh.

Tabulka 3.2

SFP — předobchodní prahová hodnota LIS

Kategorie aktiv – strukturované finanční produkty (SFP)
Předobchodní LIS
250 000 EUR

▼B

4. **Sekuritizované deriváty**

▼M3

Tabulka 4.1

Sekuritizované deriváty – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – sekuritizované deriváty
Těmito deriváty se rozumí převoditelný cenný papír ve smyslu čl. 4 odst. 1 bodu 44) písm. c) směrnice 2014/65/EU lišící se od strukturovaných finančních produktů, který zahrnuje nejméně:
a.1) standardní kryté warranty, kterými se rozumí cenné papíry vydané finanční institucí dávající držiteli právo, nikoliv však povinnost a) koupit k datu ukončení platnosti nebo do data ukončení platnosti určité množství podkladového aktiva za předem stanovenou realizační cenu, nebo v případě, že bylo stanoveno hotovostní vypořádání, přijmout úhradu kladného rozdílu mezi aktuální tržní cenou a realizační cenou od prodávajícího, nebo b) prodat k datu ukončení platnosti nebo do data ukončení platnosti určité množství podkladového aktiva za předem stanovenou realizační cenu, nebo v případě, že bylo stanoveno hotovostní vypořádání, přijmout úhradu kladného rozdílu mezi realizační cenou a aktuální tržní cenou od kupujícího;
a.2) warranty, kterými se rozumí cenné papíry vydané stejným emitentem podkladového aktiva dávající držiteli právo, nikoliv však povinnost a) koupit k datu ukončení platnosti nebo do data ukončení platnosti určité množství podkladového aktiva za předem stanovenou realizační cenu, nebo v případě, že bylo stanoveno hotovostní vypořádání, přijmout úhradu kladného rozdílu mezi aktuální tržní cenou a realizační cenou od prodávajícího, nebo b) prodat k datu ukončení platnosti nebo do data ukončení platnosti určité množství podkladového aktiva za předem stanovenou realizační cenu, nebo v případě, že bylo stanoveno hotovostní vypořádání, přijmout úhradu kladného rozdílu mezi realizační cenou a aktuální tržní cenou od kupujícího;
b) spekulativní certifikáty (leverage certificate), kterými se rozumí certifikáty, které sledují vývoj podkladového aktiva se spekulativním účinkem;
c) exotické kryté warranty (exotic covered warrants), kterými se rozumí kryté warranty, jejichž hlavní složkou je kombinace opcí;
d) obchodovatelná práva, jejichž podkladovým nástrojem je nekapitálový nástroj;
e) investiční certifikáty, kterými se rozumí certifikáty, které sledují vývoj podkladového aktiva bez spekulativního účinku.
RTS2#3 = SDRV
Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika
Všechny sekuritizované deriváty se považují za mající likvidní trh.

▼M4

Tabulka 4.2

Sekuritizované deriváty – předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS

Kategorie aktiv – sekuritizované deriváty		
Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS		
Předobchodní LIS	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

▼B

5. **Úrokové deriváty**

▼M3

Tabulka 5.1

Úrokové deriváty – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – úrokové deriváty				
Jakákoli smlouva ve smyslu přílohy I oddílu C bodu 4 směrnice 2014/65/EU, jejímž hlavním podkladovým nástrojem je úroková sazba, dluhopis, půjčka, jakýkoli koš, portfolio nebo index zahrnující úrokovou sazbu, dluhopis, půjčku nebo jakýkoli jiný produkt představující vývoj úrokové sazby, dluhopisu, půjčky.				
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.**		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
Dluhopisové futures/forwardy **/ Future na dluhopisový future**	Podkategorie dluhopisových futures/forwardů je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS2#17) – emitent podkladového nástroje **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#18) – termín podkladového dodatelného dluhopisu definovaný takto:	5 000 000 EUR	10	Kdykoli je podkategorie určena jako mající likvidní trh, pokud jde o konkrétní čas do doby zbytkové splatnosti, a podkategorie definovaná příštím časem do doby zbytkové splatnosti je určena

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
/ Forward na dluhopisový future **Future na dluhopis** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = BOND** **nebo** **Forward na dluhopis** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FORW** **RTS2#16 = BOND** **nebo** **Future na dluhopisový future** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR**	**Krátkodobý**: podkladový dodatelný dluhopis s termínem do 4 let se považuje za krátkodobý **Střednědobý**: podkladový dodatelný dluhopis s termínem mezi 4 a 8 roky se považuje za střednědobý **Dlouhodobý**: podkladový dodatelný dluhopis s termínem mezi 8 a 15 roky se považuje za dlouhodobý **Ultra-dlouhodobý**: podkladový dodatelný dluhopis s termínem delším než 15 let se považuje za ultradlouhodobý **Kritérium pro segmentaci 3** – čas do doby zbytkové splatnosti futures definovaný takto: Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce Zbytková splatnost 2: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců Zbytková splatnost 3: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok Zbytková splatnost 4: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky Zbytková splatnost 5: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let			jako nemající likvidní trh, je smlouva s prvním nejzazším měsícem splatnosti (back month) určena jako mající likvidní trh 2 týdny před vypršením prvního měsíce splatnosti (front month).

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
RTS2#5 = FUTR **RTS2#16 = BNFD** **nebo** **Forward na dluhopisový future** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FORW** **RTS2#16 = BNFD**				
Opce na dluhopisy **/ Opce na dluhopisovou opci** **/ Opce na dluhopisový future** **Opce na dluhopisy** **Opce na dluhopisovou opci** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR**	Podkategorie dluhopisových opcí je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1 (RTS2#22)** – hlavní podkladový dluhopis **Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8)** – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto: Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce Zbytková splatnost 2: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců Zbytková splatnost 3: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok Zbytková splatnost 4: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky Zbytková splatnost 5: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	5 000 000 EUR	10	

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
RTS2#5 = OPTN **RTS2#16 = BOND** **nebo** **Opce na dluhopisovou opci** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = BOND** **nebo** **Opce na dluhopisový future** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = BNFD**				

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
Úrokové futures a dohody o forwardových úrokových mírách / Future na úrokový future / Dohoda o forwardových úrokových mírách na úrokový future **Úrokový future** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = INTR** **nebo** **Dohoda o forwardových úrokových mírách** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FRAS** **RTS2#16 = INTR** **nebo** **Future na úrokový future**	Podkategorie úrokových futures je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS2#24) – podkladová úroková sazba **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#25) – termín podkladové úrokové sazby **Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#8)** – čas do doby zbytkové splatnosti futures definovaný takto: Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce Zbytková splatnost 2: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců Zbytková splatnost 3: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok Zbytková splatnost 4: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky Zbytková splatnost 5: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	500 000 000 EUR	10	Kdykoli je podkategorie určena jako mající likvidní trh, pokud jde o konkrétní čas do doby zbytkové splatnosti, a podkategorie definovaná příštím časem do doby zbytkové splatnosti je určena jako nemající likvidní trh, je smlouva s prvním nejzazším měsícem splatnosti (back month) určena jako mající likvidní trh 2 týdny před vypršením prvního měsíce splatnosti (front month).

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
RTS2#3 = DERV **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = IFUT** **nebo** **Dohoda o forwardových úrokových mírách na úrokový future** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FRAS** **RTS2#16 = IFUT**				
Úrokové opce **/ Opce na úrokový future / dohodu o forwardových úrokových mírách** **/ Opce na úrokovou opci**	Podkategorie úrokových opcí je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1 (RTS2#24)** – podkladová úroková sazba **Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#25)** – termín podkladové úrokové sazby **Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#8)** – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto: Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce	500 000 000 EUR	10	

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
/ Opce na opci na úrokový future / dohodu o forwardových úrokových mírách **Opce na úrokový future / dohodu o forwardových úrokových mírách // Opce na úrokovou opci** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = IFUT** **nebo** **Úroková opce // Opce na opci na úrokový future / dohodu o forwardových úrokových mírách** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = INTR**	Zbytková splatnost 2: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců Zbytková splatnost 3: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok Zbytková splatnost 4: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky Zbytková splatnost 5: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let			

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
Swapce **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = SWPT**	Podkategorie swapcí je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS2#16) – podkladový druh swapu definovaný takto: měnový swap jedné měny, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami (fixed-to-fixed single currency swap), futures/forwardy na měnový swap jedné měny, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami [**RTS2#16 = XXSC**] měnový swap jedné měny, kdy probíhá swap měny s pevnou úrokovou sazbou a měny s pohyblivou úrokovou sazbou (fixed-to-float single currency swap), futures/forwardy na měnový swap jedné měny, kdy probíhá swap měny s pevnou úrokovou sazbou a měny s pohyblivou úrokovou sazbou [**RTS2#16 = XFSC**] měnový swap jedné měny, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami (float-to-float single currency swap), futures/forwardy na měnový swap jedné měny, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami [**RTS2#16 = FFSC**] inflační měnový swap jedné měny (inflation single currency swap), futures/forwardy na inflační měnový swap jedné měny [**RTS2#16 = IFSC**] swap jedné měny na bázi OIS (OIS single currency swap), futures/forwardy na swap jedné měny na bázi OIS [**RTS2#16 = OSSC**] měnový swap více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou (fixed-to-fixed multi-currency swap), futures/forwardy na měnový swap více měn, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami **[RTS2#16 = XXMC]**	500 000 000 EUR	10	

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
	měnový swap více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou a měn s pohyblivou úrokovou sazbou (fixed-to-float multi-currency swap), futures/forwardy na měnový swap více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou a měn s pohyblivou úrokovou sazbou [**RTS2#16 = XFMC**]			
	měnový swap více měn, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami (float-to-float multi-currency swap), futures/forwardy na měnový swap více měn, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami [**RTS2#16 = FFMC**]			
	inflační měnový swap více měn (inflation multi-currency swap), futures/forwardy na inflační měnový swap více měn [**RTS2#16 = IFMC**]			
	swap více měn na bázi OIS (OIS multi-currency swap), futures/forwardy na swap více měn na bázi OIS [**RTS2#16 = OSMC**]			
	Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#20) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka opce			
	Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#22 nebo RTS2#23) – index inflace, je-li podkladovým druhem swapu buď inflační měnový swap jedné měny, nebo inflační měnový swap více měn			
	Kritérium pro segmentaci 4 (RTS2#21) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:			
	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc			
	Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce			

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
	Zbytková splatnost 3: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců Zbytková splatnost 4: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok Zbytková splatnost 5: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky Zbytková splatnost 6: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let **Kritérium pro segmentaci 5** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto: **Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců **Zbytková splatnost 2**: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok **Zbytková splatnost 3**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky **Zbytková splatnost 4**: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 5 roky **Zbytková splatnost 5**: 5 roky < čas do doby splatnosti ≤ 10 roky **Zbytková splatnost 6**: nad 10 let			

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
Měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou a měn s pohyblivou úrokovou sazbou (multi-currency swaps nebo cross-currency swaps) a futures/forwardy/opce na měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou a měn s pohyblivou úrokovou sazbou Swap nebo futures/forward/opce na swap, kdy si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované v různých měnách a peněžní toky jedné komponenty jsou určeny pevnou úrokovou sazbou a peněžní toky druhé komponenty jsou určeny pohyblivou úrokovou sazbou. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS RTS2#16 = XFMC	Podkategorie měnových swapů více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou a měn s pohyblivou úrokovou sazbou, je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#13 a RTS23#42) – dvojice jmenovitých měn definovaná jako kombinace dvou měn, v nichž jsou denominovány dané dvě komponenty swapu **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto: Zbytková splatnost 1: 0 < splatnost ≤ 1 měsíc Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < splatnost ≤ 3 měsíce Zbytková splatnost 3: 3 měsíce < splatnost ≤ 6 měsíců Zbytková splatnost 4: 6 měsíců < splatnost ≤ 1 rok Zbytková splatnost 5: 1 rok < splatnost ≤ 2 roky Zbytková splatnost 6: 2 roky < splatnost ≤ 3 roky … Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
Měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami (multi-currency swaps nebo cross-currency swaps) a futures/forwardy/opce na měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami Swap nebo future/forward/opce na swap, kdy si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované v různých měnách a kde jsou peněžní toky obou komponent určeny pohyblivými úrokovými sazbami RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS RTS2#16 = FFMC	Podkategorie měnových swapů více měn, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami, je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#13 a RTS23#42) – dvojice jmenovitých měn definovaná jako kombinace dvou měn, v nichž jsou denominovány dané dvě komponenty swapu **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto: Zbytková splatnost 1: 0 < splatnost ≤ 1 měsíc Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < splatnost ≤ 3 měsíce Zbytková splatnost 3: 3 měsíce < splatnost ≤ 6 měsíců Zbytková splatnost 4: 6 měsíců < splatnost ≤ 1 rok Zbytková splatnost 5: 1 rok < splatnost ≤ 2 roky Zbytková splatnost 6: 2 roky < splatnost ≤ 3 roky … Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
Měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami (multi-currency swaps nebo cross-currency swaps), a futures/forwardy/opce na měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami Swap nebo future/forward/opce na swap, kdy si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované v různých měnách a kde jsou peněžní toky obou komponent určeny pevnými úrokovými sazbami RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS RTS2#16 = XXMC	Podkategorie měnových swapů více měn, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami, je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#13 a RTS23#42) – dvojice jmenovitých měn definovaná jako kombinace dvou měn, v nichž jsou denominovány dané dvě komponenty swapu **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto: Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce Zbytková splatnost 3: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců Zbytková splatnost 4: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok Zbytková splatnost 5: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky Zbytková splatnost 6: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
Swapy více měn na bázi OIS (OIS multi-currency swaps nebo OIS cross-currency swaps), a futures/forwardy/opce na swapy více měn na bázi OIS (overnight index swap, jednodenní indexový swap) Swap nebo future/forward/opce na swap, kdy si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované v různých měnách a kde jsou peněžní toky alespoň jedné z komponent určeny sazbou jednodenního indexového swapu (OIS) RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS RTS2#16 = OSMC	Podkategorie swapů více měn na bázi OIS je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#13 a RTS23#42) – dvojice jmenovitých měn definovaná jako kombinace dvou měn, v nichž jsou denominovány dané dvě komponenty swapu **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto: Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce Zbytková splatnost 3: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců Zbytková splatnost 4: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok Zbytková splatnost 5: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky Zbytková splatnost 6: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
Inflační měnové swapy více měn (inflation multi-currency swaps nebo inflation cross-currency swaps) a futures/forwardy/opce na inflační měnové swapy více měn Swap nebo future/forward/opce na swap, kdy si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované v různých měnách a kde jsou peněžní toky alespoň jedné z komponent určeny mírou inflace **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS RTS2#16 = IFMC	Podkategorie inflačních měnových swapů více měn je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#13 a RTS23#42) – dvojice jmenovitých měn definovaná jako kombinace dvou měn, v nichž jsou denominovány dané dvě komponenty swapu **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto: Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce Zbytková splatnost 3: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců Zbytková splatnost 4: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok Zbytková splatnost 5: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky Zbytková splatnost 6: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
Měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měny s pevnou úrokovou sazbou a měny s pohyblivou úrokovou sazbou (fixed-to-float single currency swaps), a futures/forwardy/opce na měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měny s pevnou úrokovou sazbou a měny s pohyblivou úrokovou sazbou Swap nebo future/forward/opce na swap, kdy si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované ve stejné měně a peněžní toky jedné komponenty jsou určeny pevnou úrokovou sazbou, zatímco toky druhé komponenty jsou určeny pohyblivou úrokovou sazbou **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS RTS2#16 = XFSC	Podkategorie měnových swapů jedné měny, kdy probíhá swap měny s pevnou úrokovou sazbou a měny s pohyblivou úrokovou sazbou, je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#13) – jmenovitá měna, v níž jsou denominovány obě komponenty swapu **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto: Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce Zbytková splatnost 3: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců Zbytková splatnost 4: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok Zbytková splatnost 5: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky Zbytková splatnost 6: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
Měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami (float-to-float single currency swaps), a futures/forwardy/opce na měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami Swap nebo future/forward/opce na swap, kde si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované ve stejné měně a kde jsou peněžní toky obou komponent určeny pohyblivými úrokovými sazbami RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS RTS2#16 = FFSC	Podkategorie měnových swapů jedné měny, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami, je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#13) – jmenovitá měna, v níž jsou denominovány obě komponenty swapu **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto: Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce Zbytková splatnost 3: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců Zbytková splatnost 4: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok Zbytková splatnost 5: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky Zbytková splatnost 6: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
Měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami (fixed-to-fixed single currency swaps), a futures/forwardy/opce na měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami Swap nebo future/forward/opce na swap, kdy si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované ve stejné měně a kde jsou peněžní toky obou komponent určeny pevnými úrokovými sazbami RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS RTS2#16 = XXSC	Podkategorie měnových swapů jedné měny, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami, je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#13) – jmenovitá měna, v níž jsou denominovány obě komponenty swapu **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto: Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce Zbytková splatnost 3: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců Zbytková splatnost 4: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok Zbytková splatnost 5: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky Zbytková splatnost 6: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
Swapy jedné měny na bázi OIS (OIS single currency swaps) a futures/forwardy/opce na swapy jedné měny na bázi OIS Swap nebo future/forward/opce na swap, kdy si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované ve stejné měně a kde jsou peněžní toky alespoň jedné z komponent určeny sazbou jednodenního indexového swapu (OIS) **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS RTS2#16 = OSSC	Podkategorie swapů jedné měny na bázi OIS je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#13) – jmenovitá měna, v níž jsou denominovány obě komponenty swapu **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto: Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce Zbytková splatnost 3: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců Zbytková splatnost 4: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok Zbytková splatnost 5: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky Zbytková splatnost 6: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity**
Inflační měnové swapy jedné měny (inflation single currency swaps) a futures/forwardy/opce na inflační měnové swapy jedné měny Swap nebo future/forward/opce na swap, kdy si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované ve stejné měně a kde jsou peněžní toky alespoň jedné z komponent určeny mírou inflace **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS RTS2#16 = IFSC	Podkategorie inflačních měnových swapů jedné měny je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#13) – jmenovitá měna, v níž jsou denominovány obě komponenty swapu **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto: Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce Zbytková splatnost 3: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců Zbytková splatnost 4: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok Zbytková splatnost 5: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky Zbytková splatnost 6: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Kategorie aktiv – úrokové deriváty	
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika**
Jiné úrokové deriváty Úrokový derivát, který nepatří mezi žádné z výše uvedených podkategorií aktiv **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = OTHR	Jakýkoli jiný úrokový derivát se považuje za nemající likvidní trh.

▼M4

Tabulka 5.2

Úrokové deriváty – předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako mající likvidní trh

Kategorie aktiv – úrokové deriváty									
Podkategorie aktiv	**Percentily a spodní hranice prahové hodnoty, které se použijí pro výpočet předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS pro každou podkategorii určenou jako mající likvidní trh**								
	Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot	**Předobchodní LIS**		**Poobchodní SSTI**			**Poobchodní LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**
Dluhopisové futures/forwardy	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	5 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
Opce na dluhopisy	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	5 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
Úrokové futures a dohoda o forwardových úrokových mírách	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	10 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – úrokové deriváty									
Podkategorie aktiv	**Percentily a spodní hranice prahové hodnoty, které se použijí pro výpočet předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS pro každou podkategorii určenou jako mající likvidní trh**								
	Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot	**Předobchodní LIS**		**Poobchodní SSTI**			**Poobchodní LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**
Úrokové opce	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	10 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
Swapce	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou a měn s pohyblivou úrokovou sazbou („fixed-to-float multi-currency swaps“ nebo „fixed-to-float cross-currency swaps“), a futures/forwardy na měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou a měn s pohyblivou úrokovou sazbou	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – úrokové deriváty									
Podkategorie aktiv	**Percentily a spodní hranice prahové hodnoty, které se použijí pro výpočet předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS pro každou podkategorii určenou jako mající likvidní trh**								
	Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot	**Předobchodní LIS**		**Poobchodní SSTI**			**Poobchodní LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**
Měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pohyblivou úrokovou sazbou („float-to-float multi-currency swaps“ nebo „float-to-float cross-currency swaps“), a futures/forwardy na měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pohyblivou úrokovou sazbou	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou („fixed-to-fixed multi-currency swaps“ nebo „fixed-to-fixed cross-currency swaps“), a futures/forwardy na měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – úrokové deriváty									
Podkategorie aktiv	**Percentily a spodní hranice prahové hodnoty, které se použijí pro výpočet předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS pro každou podkategorii určenou jako mající likvidní trh**								
	Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot	**Předobchodní LIS**		**Poobchodní SSTI**			**Poobchodní LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**
Jednodenní indexový swap (OIS) měnových swapů více měn („OIS multi-currency swaps“ nebo „OIS cross-currency swaps“) a futures/forwardy na jednodenní indexový swap (OIS) měnových swapů více měn	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Inflační měnové swapy více měn („inflation multi-currency swaps“ nebo „inflation cross-currency swaps“) a futures/forwardy na inflační měnové swapy více měn	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měny s pevnou úrokovou sazbou a měny s pohyblivou úrokovou sazbou („fixed-to-float single currency swaps“), a futures/forwardy na měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měny s pevnou úrokovou sazbou a měny s pohyblivou úrokovou sazbou	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – úrokové deriváty									
Podkategorie aktiv	**Percentily a spodní hranice prahové hodnoty, které se použijí pro výpočet předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS pro každou podkategorii určenou jako mající likvidní trh**								
	Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot	**Předobchodní LIS**		**Poobchodní SSTI**			**Poobchodní LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**
Měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami („float-to-float single currency swaps“), a futures/forwardy na měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami („fixed-to-fixed single currency swaps“), a futures/forwardy na měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Jednodenní indexový swap (OIS) měnových swapů jedné měny („OIS single currency swaps“) a futures/forwardy na jednodenní indexový swap (OIS) měnových swapů jedné měny	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – úrokové deriváty									
Podkategorie aktiv	**Percentily a spodní hranice prahové hodnoty, které se použijí pro výpočet předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS pro každou podkategorii určenou jako mající likvidní trh**								
	Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot	**Předobchodní LIS**		**Poobchodní SSTI**			**Poobchodní LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**
Inflační měnové swapy jedné měny („inflation single currency swaps“) a futures/forwardy na inflační měnové swapy jedné měny	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

Tabulka 5.3

Úrokové deriváty – předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – úrokové deriváty			
Podkategorie aktiv	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro každou podkategorii určenou jako nemající likvidní trh**		
	Předobchodní LIS	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Dluhopisové futures/forwardy	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Opce na dluhopisy	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Úrokové futures a dohoda o forwardových úrokových mírách	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – úrokové deriváty			
Podkategorie aktiv	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro každou podkategorii určenou jako nemající likvidní trh**		
	Předobchodní LIS	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Úrokové opce	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Swapce	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou a měn s pohyblivou úrokovou sazbou („fixed-to-float multi-currency swaps“ nebo „fixed-to-float cross-currency swaps“), a futures/forwardy na měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou a měn s pohyblivou úrokovou sazbou	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pohyblivou úrokovou sazbou („float-to-float multi-currency swaps“ nebo „float-to-float cross-currency swaps“), a futures/forwardy na měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pohyblivou úrokovou sazbou	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou („fixed-to-fixed multi-currency swaps“ nebo „fixed-to-fixed cross-currency swaps“), a futures/forwardy na měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Jednodenní indexový swap (OIS) měnových swapů více měn („OIS multi-currency swaps“ nebo „OIS cross-currency swaps“) a futures/forwardy na jednodenní indexový swap (OIS) měnových swapů více měn	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Inflační měnové swapy více měn („inflation multi-currency swaps“ nebo „inflation cross-currency swaps“) a futures/forwardy na inflační měnové swapy více měn	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měny s pevnou úrokovou sazbou a měny s pohyblivou úrokovou sazbou („fixed-to-float single currency swaps“), a futures/forwardy na měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měny s pevnou úrokovou sazbou a měny s pohyblivou úrokovou sazbou	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – úrokové deriváty			
Podkategorie aktiv	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro každou podkategorii určenou jako nemající likvidní trh**		
	Předobchodní LIS	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami („float-to-float single currency swaps“), a futures/forwardy na měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami („fixed-to-fixed single currency swaps“), a futures/forwardy na měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Jednodenní indexový swap (OIS) měnových swapů jedné měny („OIS single currency swaps“) a futures/forwardy na jednodenní indexový swap (OIS) měnových swapů jedné měny	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Inflační měnové swapy jedné měny („inflation single currency swaps“) a futures/forwardy na inflační měnové swapy jedné měny	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Jiné úrokové deriváty	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR

▼B

6. **Akciové deriváty**

▼M3

Tabulka 6.1

Akciové deriváty – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – akciové deriváty
Jakákoli smlouva ve smyslu přílohy I oddílu C bodu 4 směrnice 2014/65/EU týkající se:
a) jedné nebo více akcií, cenných papírů nahrazujících jiné cenné papíry, fondů obchodovaných v obchodním systému, certifikátů a jiných podobných finančních nástrojů, peněžních toků nebo jiných produktů souvisejících s výkonností jedné nebo více akcií, cenných papírů nahrazujících jiné cenné papíry, fondů obchodovaných v obchodním systému, certifikátů nebo jiných podobných finančních nástrojů;
b) indexu akcií, cenných papírů nahrazujících jiné cenné papíry, fondů obchodovaných v obchodním systému, certifikátů a jiných podobných finančních nástrojů, peněžních toků nebo jiných produktů souvisejících s výkonností jedné nebo více akcií, cenných papírů nahrazujících jiné cenné papíry, fondů obchodovaných v obchodním systému, certifikátů nebo jiných podobných finančních nástrojů.

▼M3

Kategorie aktiv – akciové deriváty	
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika**
Opce na akciové indexy Opce, jejímž podkladovým nástrojem je index složený z akcií RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = STIX RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28	Všechny indexové opce se považují za mající likvidní trh.
Futures/forwardy na akciové indexy Futures/forwardy, jejichž podkladovým nástrojem je index složený z akcií RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR nebo FORW RTS2#27 = STIX RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28	Všechny indexové futures/forwardy se považují za mající likvidní trh.
Akciové opce Opce, jejímž podkladovým nástrojem je akcie nebo koš akcií vyplývající z podnikových opatření RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = SHRS RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28	Všechny akciové opce se považují za mající likvidní trh.

▼M3

Kategorie aktiv – akciové deriváty	
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika**
Akciové futures/forwardy Futures/forwardy, jejichž podkladovým nástrojem je akcie nebo koš akcií vyplývající z podnikových opatření RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR nebo FORW RTS2#27 = SHRS RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28	Všechny akciové futures/forwardy se považují za mající likvidní trh.
Opce na akciové dividendy Opce na dividendu konkrétní akcie RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = DVSE RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28	Všechny opce na akciové dividendy se považují za mající likvidní trh.
Futures/forwardy na akciové dividendy Futures/forward na dividendu konkrétní akcie RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR nebo FORW RTS2#27 = DVSE RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28	Všechny futures/forwardy na akciové dividendy se považují za mající likvidní trh.

▼M3

Kategorie aktiv – akciové deriváty	
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika**
Opce na dividendový index Opce na dividendový index složený z dividend více než jedné akcie RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = DIVI RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28	Všechny opce na dividendový index se považují za mající likvidní trh.
Futures/forwardy na dividendový index Futures/forwardy na dividendový index složený z dividend více než jedné akcie RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR nebo FORW RTS2#27 = DIVI RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28	Všechny futures/forwardy na dividendový index se považují za mající likvidní trh.
Opce na index volatility Opce, jejímž podkladovým nástrojem je index volatility definovaný jako index týkající se volatility konkrétního podkladového indexu kapitálových nástrojů RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = VOLI RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28	Všechny opce na index volatility se považují za mající likvidní trh.

▼M3

Kategorie aktiv – akciové deriváty	
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika**
Futures/forwardy na index volatility Futures/forwardy, jejichž podkladovým nástrojem je index volatility definovaný jako index týkající se volatility konkrétního podkladového indexu kapitálových nástrojů RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR nebo FORW RTS2#27 = VOLI RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28	Všechny futures/forwardy na index volatility se považují za mající likvidní trh.
Opce na fond obchodovaný v obchodním systému (ETF) Opce, jejímž podkladovým nástrojem je ETF RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = ETFS RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28	Všechny opce na fond obchodovaný v obchodním systému se považují za mající likvidní trh.
Futures/forwardy na fond obchodovaný v obchodním systému (ETF) Futures/forwardy, jejichž podkladovým nástrojem je ETF RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR nebo FORW RTS2#27 = ETFS RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28	Všechny futures/forwardy na fond obchodovaný v obchodním systému se považují za mající likvidní trh.

▼M3

<table>
<tr><th colspan="5">Kategorie aktiv – akciové deriváty</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Podkategorie aktiv</th><th colspan="3" rowspan="2">Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále segmentuje na podkategorie definované níže</th><th colspan="2">Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity</th></tr>
<tr><th>Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]</th><th>Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]</th></tr>
<tr><td>Swapy
RTS2#3 = DERV
RTS2#4 = EQUI
RTS2#5 = SWAP</td><td colspan="3">Podkategorie swapů je definována následujícími kritérii pro segmentaci:
Kritérium pro segmentaci 1 (RTS2#27) – druh podkladového nástroje: na jedno jméno, index, koš
Kritérium pro segmentaci 2 (RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28) – podkladové jedno jméno, podkladový index, podkladový koš
Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#28) – parametr: parametr výnosnosti základního vývoje (price return basic performance parameter), parametr výnosnosti dividend (parameter return dividend), parametr variance výnosnosti (parameter return variance), parametr volatility výnosnosti (parameter return volatility)
Kritérium pro segmentaci 4 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:
<table><tr><th>Parametr výnosnosti základního vývoje</th><th>Parametr variance/volatility výnosnosti</th><th>Parametr výnosnosti dividend</th></tr><tr><td>Zbytková splatnost 1:
0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc</td><td>Zbytková splatnost 1:
0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce</td><td>Zbytková splatnost 1:
0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td></tr><tr><td>Zbytková splatnost 2:
1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce</td><td>Zbytková splatnost 2:
3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců</td><td>Zbytková splatnost 2:
1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</td></tr><tr><td>Zbytková splatnost 3:
3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců</td><td>Zbytková splatnost 3:
6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td><td>Zbytková splatnost 3:
2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky</td></tr><tr><td>Zbytková splatnost 4:
6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td><td>Zbytková splatnost 4:
1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</td><td>…</td></tr></table></td><td>50 000 000 EUR</td><td></td></tr>
</table>

▼M3

Kategorie aktiv – akciové deriváty					
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále segmentuje na podkategorie definované níže**			**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity**	
				Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	Zbytková splatnost 5: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	**Zbytková splatnost 5**: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky	**Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let		
	Zbytková splatnost 6: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky	…			
	…	**Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let			
	Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let				
Portfoliové swapy RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = PSWP	Podkategorie portfoliových swapů je definována touto specifickou kombinací: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS2#27) – druh podkladového nástroje: na jedno jméno, index, koš **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28) – podkladové jedno jméno, podkladový index, podkladový koš **Kritérium pro segmentaci 3** (RTS2#28) – parametr: parametr výnosnosti základního vývoje (price return basic performance parameter), parametr výnosnosti dividend (parameter return dividend), parametr variance výnosnosti (parameter return variance), parametr volatility výnosnosti (parameter return volatility) **Kritérium pro segmentaci 4** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti portfoliového swapu definovaný takto: **Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc **Zbytková splatnost 2:** 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce **Zbytková splatnost 3:** 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců **Zbytková splatnost 4:** 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok **Zbytková splatnost 5:** 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky **Zbytková splatnost 6:** 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … **Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let			50 000 000 EUR	15

▼M3

Kategorie aktiv – akciové deriváty	
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika**
Jiné akciové deriváty – akciový derivát, který nepatří do žádné z výše uvedených podkategorií aktiv RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OTHR	Jakýkoli jiný akciový derivát se považuje za nemající likvidní trh.

▼M4

Tabulka 6.2

Akciové deriváty – předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako mající likvidní trh

Kategorie aktiv – akciové deriváty						
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS se každá podkategorie aktiv dále segmentuje na podkategorie definované níže**	**Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot**	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS určené pro podkategorie určené jako mající likvidní trh na základě rozpětí průměrné denní pomyslné částky (ADNA), do něhož daná podkategorie patří**			
			Průměrná denní pomyslná částka (ADNA)	**Předobchodní LIS**	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
				Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Opce na akciové indexy	podkategorie opcí na akciové indexy je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** – podkladový akciový index	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	< 100 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mil. EUR ≤ ADNA < 600 mil. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 mil. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – akciové deriváty						
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS se každá podkategorie aktiv dále segmentuje na podkategorie definované níže**	**Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot**	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS určené pro podkategorie určené jako mající likvidní trh na základě rozpětí průměrné denní pomyslné částky (ADNA), do něhož daná podkategorie patří**			
			Průměrná denní pomyslná částka (ADNA)	**Předobchodní LIS**	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
				Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Futures/forwardy na akciové indexy	podkategorie futures/forwardů na akciové indexy je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** – podkladový akciový index	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	< 100 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 1 mld. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mld. EUR ≤ ADNA < 3 mld. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mld. EUR ≤ ADNA < 5 mld. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 mld. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Akciové opce	podkategorie akciových opcí je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** – podkladové akcie	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	< 5 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – akciové deriváty						
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS se každá podkategorie aktiv dále segmentuje na podkategorie definované níže**	**Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot**	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS určené pro podkategorie určené jako mající likvidní trh na základě rozpětí průměrné denní pomyslné částky (ADNA), do něhož daná podkategorie patří**			
			Průměrná denní pomyslná částka (ADNA)	**Předobchodní LIS**	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
				Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Akciové futures/ forwardy	podkategorie akciových futures/forwardů je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** – podkladové akcie	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	< 5 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
Opce na akciové dividendy	podkategorie opcí na akciové dividendy je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** – podkladové akcie opravňující k dividendám	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	< 5 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – akciové deriváty						
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS se každá podkategorie aktiv dále segmentuje na podkategorie definované níže**	**Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot**	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS určené pro podkategorie určené jako mající likvidní trh na základě rozpětí průměrné denní pomyslné částky (ADNA), do něhož daná podkategorie patří**			
			Průměrná denní pomyslná částka (ADNA)	**Předobchodní LIS**	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
				Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Futures/forwardy na akciové dividendy	podkategorie futures/forwardů na akciové dividendy je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** – podkladové akcie opravňující k dividendám	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	< 5 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR
Opce na dividendový index	podkategorie opcí na dividendový index je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** – podkladový dividendový index	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	< 100 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mil. EUR ≤ ADNA < 600 mil. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 mil. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – akciové deriváty						
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS se každá podkategorie aktiv dále segmentuje na podkategorie definované níže**	**Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot**	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS určené pro podkategorie určené jako mající likvidní trh na základě rozpětí průměrné denní pomyslné částky (ADNA), do něhož daná podkategorie patří**			
			Průměrná denní pomyslná částka (ADNA)	**Předobchodní LIS**	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
				Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Futures/forwardy na dividendový index	podkategorie futures/forwardů na dividendový index je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** – podkladový dividendový index	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	< 100 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 1 mld. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mld. EUR ≤ ADNA < 3 mld. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mld. EUR ≤ ADNA < 5 mld. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 mld. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Opce na index volatility	podkategorie opcí na index volatility je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** – podkladový index volatility	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	< 100 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mil. EUR ≤ ADNA < 600 mil. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 mil. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – akciové deriváty						
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS se každá podkategorie aktiv dále segmentuje na podkategorie definované níže**	**Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot**	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS určené pro podkategorie určené jako mající likvidní trh na základě rozpětí průměrné denní pomyslné částky (ADNA), do něhož daná podkategorie patří**			
			Průměrná denní pomyslná částka (ADNA)	**Předobchodní LIS**	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
				Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Futures/forwardy na index volatility	podkategorie futures/forwardů na index volatility je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** – podkladový index volatility	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	< 100 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 1 mld. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mld. EUR ≤ ADNA < 3 mld. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mld. EUR ≤ ADNA < 5 mld. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 mld. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Opce na fond obchodovaný v obchodním systému (ETF)	podkategorie opcí na fond obchodovaný v obchodním systému (ETF) je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** – podkladový ETF	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	< 5 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – akciové deriváty						
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS se každá podkategorie aktiv dále segmentuje na podkategorie definované níže**	**Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot**	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS určené pro podkategorie určené jako mající likvidní trh na základě rozpětí průměrné denní pomyslné částky (ADNA), do něhož daná podkategorie patří**			
			Průměrná denní pomyslná částka (ADNA)	**Předobchodní LIS**	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
				Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Futures/forwardy na fond obchodovaný v obchodním systému (ETF)	podkategorie futures/forwardů na fond obchodovaný v obchodním systému je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** – podkladový ETF	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	< 5 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
Swapy	podkategorie swapů je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** – druh podkladového nástroje: na jedno jméno, index, koš **Kritérium pro segmentaci 2** – podkladové jedno jméno, podklad. index, podklad. koš **Kritérium pro segmentaci 3** – parametr: parametr výnosnosti základního vývoje (price return basic performance parameter), parametr výnosnosti dividend (parameter return dividend), parametr variance výnosnosti (parameter return variance), parametr volatility výnosnosti (parameter return volatility) **Kritérium pro segmentaci 4** – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	50 mil. EUR ≤ ADNA < 100 mil. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 200 mil. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – akciové deriváty							
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS se každá podkategorie aktiv dále segmentuje na podkategorie definované níže**			**Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot**	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS určené pro podkategorie určené jako mající likvidní trh na základě rozpětí průměrné denní pomyslné částky (ADNA), do něhož daná podkategorie patří**		
					Průměrná denní pomyslná částka (ADNA)	**Předobchodní LIS**	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
						Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
	Parametr výnosnosti základního vývoje	Parametr variance/ volatility výnosnosti	Parametr výnosnosti dividend					
	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc	**Zbytková splatnost 1:** 0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce	**Zbytková splatnost 1:** 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok					
	Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce	**Zbytková splatnost 2:** 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců	**Zbytková splatnost 2:** 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky					
	Zbytková splatnost 3: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců	**Zbytková splatnost 3:** 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	**Zbytková splatnost 3:** 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky					
	Zbytková splatnost 4: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	**Zbytková splatnost 4:** 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	…					

▼M4

Kategorie aktiv – akciové deriváty								
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS se každá podkategorie aktiv dále segmentuje na podkategorie definované níže**			**Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot**	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS určené pro podkategorie určené jako mající likvidní trh na základě rozpětí průměrné denní pomyslné částky (ADNA), do něhož daná podkategorie patří**			
					Průměrná denní pomyslná částka (ADNA)	**Předobchodní LIS**	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
						Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
	Zbytková splatnost 5: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	**Zbytková splatnost 5:** 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky	**Zbytková splatnost *m*:** (*n*–1) let < čas do doby splatnosti ≤ *n* let					
	Zbytková splatnost 6: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky	…						
	…	**Zbytková splatnost *m*:** (*n*–1) let < čas do doby splatnosti ≤ *n* let						
	Zbytková splatnost *m*: (*n*–1) let < čas do doby splatnosti ≤ *n* let							
Portfoliové swapy	Podkategorie portfoliových swapů je definována touto specifickou kombinací: **Kritérium pro segmentaci 1** – druh podkladového nástroje: na jedno jméno, index, koš **Kritérium pro segmentaci 2** – podkladové jedno jméno, podklad. index, podklad. koš **Kritérium pro segmentaci 3** – parametr: parametr výnosnosti základního vývoje (price return basic performance parameter), parametr výnosnosti dividend (parameter return dividend), parametr variance výnosnosti (parameter return variance), parametr volatility výnosnosti (parameter return volatility) **Kritérium pro segmentaci 4** – čas do doby zbytkové splatnosti portfoliového swapu definovaný takto:			výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	50 mil. EUR ≤ ADNA < 100 mil. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
					100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
					ADNA ≥ 200 mil. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – akciové deriváty						
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS se každá podkategorie aktiv dále segmentuje na podkategorie definované níže**	**Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot**	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS určené pro podkategorie určené jako mající likvidní trh na základě rozpětí průměrné denní pomyslné částky (ADNA), do něhož daná podkategorie patří**			
			Průměrná denní pomyslná částka (ADNA)	**Předobchodní LIS**	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
				Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc **Zbytková splatnost 2:** 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce **Zbytková splatnost 3:** 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců **Zbytková splatnost 4:** 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok **Zbytková splatnost 5:** 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky **Zbytková splatnost 6:** 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … **Zbytková splatnost *m*:** (*n*–1) let < čas do doby splatnosti ≤ *n* let					

Tabulka 6.3

Akciové deriváty – předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – akciové deriváty			
Podkategorie aktiv	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako nemající likvidní trh**		
	Předobchodní LIS	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Swapy	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR
Portfoliové swapy	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR
Jiné akciové deriváty	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR

▼B

7. **Komoditní deriváty**

▼M3

Tabulka 7.1

Komoditní deriváty – kategorie nemající likvidní trh

<table>
<tr><th colspan="4">Kategorie aktiv – komoditní deriváty</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Podkategorie aktiv</th><th rowspan="2" colspan="2">Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.</th><th colspan="2">Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.</th></tr>
<tr><th>Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]</th><th>Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]</th></tr>
<tr><td>Futures/forwardy na kovové komodity
RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „METL“ a [RTS2#5 = „FUTR“ nebo „FORW“]</td><td colspan="2">Podkategorie futures/forwardů na kovové komodity je definována následujícími kritérii pro segmentaci:
Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#36) – druh kovů: vzácné kovy, běžné kovy
Kritérium pro segmentaci 2 (RTS23#37) – podkladový druh kovu
Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#15) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka futures/forwardu
Kritérium pro segmentaci 4 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti futures/forwardu definovaný takto:
<table>
<tr><th>Vzácné kovy</th><th>Běžné kovy</th></tr>
<tr><td>Zbytková splatnost 1:
0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce</td><td>Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td></tr>
<tr><td>Zbytková splatnost 2:
3 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td><td>Zbytková splatnost 2: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</td></tr>
<tr><td>Zbytková splatnost 3:
1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</td><td>Zbytková splatnost 3: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky</td></tr>
</table></td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
</table>

▼M3

Kategorie aktiv – komoditní deriváty				
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**		**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.**	
			Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	Zbytková splatnost 4: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky	…		
	…	**Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let		
	Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let			
Opce na kovové komodity RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „METL“ a RTS2#5 = „OPTN“	Podkategorie opcí na kovové komodity je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#36) – druh kovů: vzácné kovy, běžné kovy **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS23#37) – podkladový druh kovu **Kritérium pro segmentaci 3** (RTS2#15) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka opce **Kritérium pro segmentaci 4** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto:		10 000 000 EUR	10
	Vzácné kovy	**Běžné kovy**		
	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce	**Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok		
	Zbytková splatnost 2: 3 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	**Zbytková splatnost 2**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky		

▼M3

Kategorie aktiv – komoditní deriváty				
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**		**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.**	
			Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	**Zbytková splatnost 3**: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky		
	Zbytková splatnost 4: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky	…		
	…	**Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let		
	Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let			
Swapy kovových komodit RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „METL“ a RTS2#5 = „SWAP“	Podkategorie swapů kovových komodit je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#36) – druh kovů: vzácné kovy, běžné kovy **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS23#37) – podkladový druh kovu **Kritérium pro segmentaci 3** (RTS2#15) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka swapu **Kritérium pro segmentaci 4** (RTS23#34) – druh dodání definovaný jako hotovostní, ve fyzické podobě nebo volitelný **Kritérium pro segmentaci 5** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:		10 000 000 EUR	10
	Vzácné kovy	**Běžné kovy**		
	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce	**Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok		

▼M3

Kategorie aktiv – komoditní deriváty				
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**		**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.**	
			Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	Zbytková splatnost 2: 3 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	**Zbytková splatnost 2**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky		
	Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	**Zbytková splatnost 3**: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky		
	Zbytková splatnost 4: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky	…		
	…	**Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let		
	Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let			
Futures/forwardy na energetické komodity RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „NRGY“ a [RTS2#5 = „FUTR“ nebo „FORW“]	Podkategorie futures/forwardů na energetické komodity je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium segmentace 1** (RTS23#36) – druh energie: ropa, destiláty ropy, uhlí, lehké ropné frakce, zemní plyn, elektřina, kombinovaná energie **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS23#37) – podkladový druh energie **Kritérium pro segmentaci 3** (RTS2#15) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka futures/forwardu **Kritérium pro segmentaci 4** – [vypouští se]		10 000 000 EUR	10

▼M3

<table>
<tr><td colspan="5">Kategorie aktiv – komoditní deriváty</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Podkategorie aktiv</td><td colspan="3" rowspan="2">Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.</td><td colspan="2">Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.</td></tr>
<tr><td>Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]</td><td>Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="3">Kritérium pro segmentaci 5 (RTS2#14) – místo dodání/hotovostního vypořádání platné pro všechny druhy energie
Kritérium pro segmentaci 6 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti futures/forwardu definovaný takto:</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Ropa / destiláty / lehké frakce</td><td>Uhlí</td><td>Zemní plyn / elektřina / kombinovaná energie</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Zbytková splatnost 1:
0 < čas do doby splatnosti ≤ 4 měsíce</td><td>Zbytková splatnost 1:
0 < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců</td><td>Zbytková splatnost 1:
0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Zbytková splatnost 2:
4 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 8 měsíců</td><td>Zbytková splatnost 2:
6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td><td>Zbytková splatnost 2:
1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Zbytková splatnost 3:
8 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td><td>Zbytková splatnost 3:
1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</td><td>Zbytková splatnost 3:
1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Zbytková splatnost 4:
1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</td><td>…</td><td>…</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>…</td><td>Zbytková splatnost m:
(n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let</td><td>Zbytková splatnost m:
(n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Zbytková splatnost m:
(n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let</td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

<table>
<tr><th colspan="4">Kategorie aktiv – komoditní deriváty</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Podkategorie aktiv</th><th rowspan="2" colspan="2">Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.</th><th colspan="2">Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.</th></tr>
<tr><th>Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]</th><th>Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]</th></tr>
<tr><td>Opce na energetické komodity
RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „NRGY“ a RTS2#5 = „OPTN“</td><td colspan="2">Podkategorie opcí na energetické komodity je definována následujícími kritérii pro segmentaci:
Kritérium segmentace 1 (RTS23#36) – druh energie: ropa, destiláty, uhlí, lehké frakce, zemní plyn, elektřina, kombinovaná energie
Kritérium pro segmentaci 2 (RTS23#37) – podkladový druh energie
Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#15) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka opce
Kritérium pro segmentaci 4 – [vypouští se]
Kritérium pro segmentaci 5 (RTS2#14) – místo dodání/hotovostního vypořádání platné pro všechny druhy energie
Kritérium pro segmentaci 6 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto:
<table>
<tr><th>Ropa / destiláty / lehké frakce</th><th>Uhlí</th><th>Zemní plyn / elektřina / kombinovaná energie</th></tr>
<tr><td>Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 4 měsíce</td><td>Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců</td><td>Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc</td></tr>
<tr><td>Zbytková splatnost 2: 4 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 8 měsíců</td><td>Zbytková splatnost 2: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td><td>Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td></tr>
</table>
</td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
</table>

▼M3

Kategorie aktiv – komoditní deriváty					
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**			**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.**	
				Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	Zbytková splatnost 3: 8 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	**Zbytková splatnost 3**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	**Zbytková splatnost 3**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky		
	Zbytková splatnost 4: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	…	…		
	…	**Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	**Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let		
	Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let				
Swapy energetických komodit RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „NRGY“ a RTS2#5 = „SWAP“	Podkategorie swapů energetických komodit je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium segmentace 1** (RTS23#36) – druh energie: ropa, destiláty, uhlí, lehké frakce, zemní plyn, elektřina, kombinovaná energie **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS23#37) – podkladový druh energie **Kritérium pro segmentaci 3** (RTS2#15) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka swapu **Kritérium pro segmentaci 4** (RTS23#34) – druh dodání definovaný jako hotovostní, ve fyzické podobě nebo volitelný **Kritérium pro segmentaci 5** – [vypouští se] **Kritérium pro segmentaci 6** (RTS2#14) – místo dodání/hotovostního vypořádání platné pro všechny druhy energie **Kritérium pro segmentaci 7** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:			10 000 000 EUR	10

▼M3

Kategorie aktiv – komoditní deriváty					
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**			**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.**	
				Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	Ropa / destiláty / lehké frakce	**Uhlí**	**Zemní plyn / elektřina / kombinovaná energie**		
	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 4 měsíce	**Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců	**Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc		
	Zbytková splatnost 2: 4 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 8 měsíců	**Zbytková splatnost 2**: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	**Zbytková splatnost 2**: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok		
	Zbytková splatnost 3: 8 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	**Zbytková splatnost 3**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	**Zbytková splatnost 3**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky		
	Zbytková splatnost 4: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	…	…		
	…	**Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	**Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let		
	Zbytková splatnost m: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let				
Futures/forwardy na zemědělské komodity RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „AGRI“ a [RTS2#5 = „FUTR“ nebo „FORW“]	Podkategorie futures/forwardů na zemědělské komodity je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#36 a RTS23#37) – podkladová zemědělská komodita (dílčí produkt a další dílčí produkt) **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#15) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka futures/forwardu			10 000 000 EUR	10

▼M3

Kategorie aktiv – komoditní deriváty			
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.**	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti futures/forwardu definovaný takto: **Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce **Zbytková splatnost 2**: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců **Zbytková splatnost 3**: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok **Zbytková splatnost 4**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky … **Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let		
Opce na zemědělské komodity RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „AGRI“ a RTS2#5 = „OPTN“	Podkategorie opcí na zemědělské komodity je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#36 a RTS23#37) – podkladová zemědělská komodita (dílčí produkt a další dílčí produkt) **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#15) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka opce **Kritérium pro segmentaci 3** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto: **Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce **Zbytková splatnost 2**: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců **Zbytková splatnost 3**: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok **Zbytková splatnost 4**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky … **Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	10 000 000 EUR	10

▼M3

Kategorie aktiv – komoditní deriváty			
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.**	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
Swapy zemědělských komodit RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „AGRI“ a RTS2#5 = „SWAP“	Podkategorie swapů zemědělských komodit je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#36 a RTS23#37) – podkladová zemědělská komodita (dílčí produkt a další dílčí produkt) **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#15) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka swapu **Kritérium pro segmentaci 3** (RTS23#34) – druh dodání definovaný jako hotovostní, ve fyzické podobě nebo volitelný **Kritérium pro segmentaci 4** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto: **Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce **Zbytková splatnost 2**: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců **Zbytková splatnost 3**: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok **Zbytková splatnost 4**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky … **Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	10 000 000 EUR	10
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika**		
Jiné komoditní deriváty Komoditní derivát, který nepatří mezi žádné z výše uvedených podkategorií aktiv	Jakýkoli jiný komoditní derivát se považuje za nemající likvidní trh.		

▼M4

Tabulka 7.2

Komoditní deriváty – předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako mající likvidní trh

Kategorie aktiv – komoditní deriváty									
Podkategorie aktiv	**Percentily a spodní hranice prahových hodnot, které se použijí pro výpočet předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS pro podkategorie určené jako mající likvidní trh**								
	Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot	**Předobchodní LIS**		**Poobchodní SSTI**			**Poobchodní LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**
Futures/forwardy na kovové komodity	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Opce na kovové komodity	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Swapy kovových komodit	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – komoditní deriváty									
Podkategorie aktiv	**Percentily a spodní hranice prahových hodnot, které se použijí pro výpočet předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS pro podkategorie určené jako mající likvidní trh**								
	Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot	**Předobchodní LIS**		**Poobchodní SSTI**			**Poobchodní LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**
Futures/forwardy na energetické komodity	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Opce na energetické komodity	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Swapy energetických komodit	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – komoditní deriváty									
Podkategorie aktiv	**Percentily a spodní hranice prahových hodnot, které se použijí pro výpočet předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS pro podkategorie určené jako mající likvidní trh**								
	Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot	**Předobchodní LIS**		**Poobchodní SSTI**			**Poobchodní LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**
Futures/forwardy na zemědělské komodity	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Opce na zemědělské komodity	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Swapy zemědělských komodit	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

▼M4

Tabulka 7.3

Komoditní deriváty – předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – komoditní deriváty			
Podkategorie aktiv	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako nemající likvidní trh**		
	Předobchodní LIS	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Futures/forwardy na kovové komodity	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Opce na kovové komodity	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Swapy kovových komodit	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Futures/forwardy na energetické komodity	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Opce na energetické komodity	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Swapy energetických komodit	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Futures/forwardy na zemědělské komodity	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Opce na zemědělské komodity	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Swapy zemědělských komodit	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Jiné komoditní deriváty	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR

▼B

8. **Měnové deriváty**

▼M3

Tabulka 8.1

Měnové deriváty – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – měnové deriváty			
Finanční nástroj týkající se měn ve smyslu přílohy I oddílu C bodu 4 směrnice 2014/65/EU			
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity**	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
Nedodatelný forward (non-deliverable forward) Tímto forwardem se rozumí forward, v němž se protistrany vypořádají hotovostně a kde je částka vypořádání určena rozdílem směnných kurzů dvou měn mezi dnem uzavření obchodu a dnem ocenění. K datu vypořádání bude jedna strana druhé straně dlužit čistý rozdíl mezi i) směnným kurzem stanoveným ke dni uzavření obchodu a ii) směnným kurzem ke dni ocenění na základě pomyslné částky, přičemž dlužná čistá částka bude splatná v měně stanovené ve smlouvě. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FORW RTS2#26 = NDLV	Podkategorie nedodatelných měnových forwardů (non-deliverable FX forward) je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#13 a RTS23#47) – dvojice podkladových měn definovaná jako kombinace dvou měn tvořících podkladový nástroj derivátové smlouvy **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti forwardu definovaný takto: **Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 týden **Zbytková splatnost 2**: 1 týden < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce **Zbytková splatnost 3**: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok **Zbytková splatnost 4**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky **Zbytková splatnost 5**: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … **Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	Nedodatelné forwardy se považují za nemající likvidní trh.	

▼M3

Kategorie aktiv – měnové deriváty			
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity**	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
Dodatelný forward (deliverable forward) Tímto forwardem se rozumí forward výlučně zahrnující výměnu dvou různých měn k určitému budoucímu datu vypořádání smlouvy za fixní sazbu odsouhlasenou při uzavření smlouvy pokrývající tuto výměnu. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FORW RTS2#26 = DLVB	Podkategorie dodatelných měnových forwardů (deliverable FX forward) je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#13 a RTS23#47) – dvojice podkladových měn definovaná jako kombinace dvou měn tvořících podkladový nástroj derivátové smlouvy **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti forwardu definovaný takto: **Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 týden **Zbytková splatnost 2**: 1 týden < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce **Zbytková splatnost 3**: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok **Zbytková splatnost 4**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky **Zbytková splatnost 5**: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … **Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	Dodatelné forwardy se považují za nemající likvidní trh.	

▼M3

Kategorie aktiv – měnové deriváty			
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity**	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
Nedodatelné měnové opce (non-deliverable FX options) Těmito opcemi se rozumí opce, v nichž se protistrany vypořádají hotovostně a kde je částka vypořádání určena rozdílem směnných kurzů dvou měn mezi dnem uzavření obchodu a dnem ocenění. K datu vypořádání bude jedna strana druhé straně dlužit čistý rozdíl mezi i) směnným kurzem stanoveným ke dni uzavření obchodu a ii) směnným kurzem ke dni ocenění na základě pomyslné částky, přičemž dlužná čistá částka bude splatná v měně stanovené ve smlouvě. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = OPTN RTS2#26 = NDLV	Podkategorie nedodatelných měnových opcí (non-deliverable FX options) je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium segmentace 1** (RTS23#13 a RTS23#47) – dvojice podkladových měn definovaná jako kombinace dvou měn tvořících podkladový nástroj derivátové smlouvy **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto: **Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 týden **Zbytková splatnost 2**: 1 týden < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce **Zbytková splatnost 3**: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok **Zbytková splatnost 4**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky **Zbytková splatnost 5**: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … **Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	Nedodatelné měnové opce se považují za nemající likvidní trh.	

▼M3

Kategorie aktiv – měnové deriváty			
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity**	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
Dodatelné měnové opce (deliverable FX options) Touto opcí se rozumí opce výlučně zahrnující výměnu dvou různých měn k určitému budoucímu datu vypořádání smlouvy za fixní sazbu odsouhlasenou při uzavření smlouvy pokrývající tuto výměnu. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = OPTN RTS2#26 = DLVB	Podkategorie dodatelných měnových opcí (deliverable FX options) je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#13 a RTS23#47) – dvojice podkladových měn definovaná jako kombinace dvou měn tvořících podkladový nástroj derivátové smlouvy **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto: **Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 týden **Zbytková splatnost 2**: 1 týden < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce **Zbytková splatnost 3**: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok **Zbytková splatnost 4**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky **Zbytková splatnost 5**: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … **Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	Dodatelné měnové opce se považují za nemající likvidní trh.	

▼M3

Kategorie aktiv – měnové deriváty			
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity**	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
Nedodatelné měnové swapy (non-deliverable FX swaps) Tímto swapem se rozumí swap, v němž se protistrany vypořádají hotovostně a kde je částka vypořádání určena rozdílem směnných kurzů dvou měn mezi dnem uzavření obchodu a dnem ocenění. K datu vypořádání bude jedna strana druhé straně dlužit čistý rozdíl mezi i) směnným kurzem stanoveným ke dni uzavření obchodu a ii) směnným kurzem ke dni ocenění na základě pomyslné částky, přičemž dlužná čistá částka bude splatná v měně stanovené ve smlouvě. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = SWAP RTS2#26 = NDLV	Podkategorie nedodatelných měnových swapů (non-deliverable FX swaps) je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#13 a RTS23#47) – dvojice podkladových měn definovaná jako kombinace dvou měn tvořících podkladový nástroj derivátové smlouvy **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto: **Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 týden **Zbytková splatnost 2**: 1 týden < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce **Zbytková splatnost 3**: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok **Zbytková splatnost 4**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky **Zbytková splatnost 5**: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … **Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	Nedodatelné měnové swapy se považují za nemající likvidní trh.	

▼M3

Kategorie aktiv – měnové deriváty			
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity**	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
Dodatelné měnové swapy (deliverable FX swaps) Tímto swapem se rozumí swap výlučně zahrnující výměnu dvou různých měn k určitému budoucímu datu vypořádání smlouvy za fixní sazbu odsouhlasenou při uzavření smlouvy pokrývající tuto výměnu. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = SWAP RTS2#26 = DLVB	Podkategorie dodatelných měnových swapů (deliverable FX swaps) je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#13 a RTS23#47) – dvojice podkladových měn definovaná jako kombinace dvou měn tvořících podkladový nástroj derivátové smlouvy **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto: **Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 týden **Zbytková splatnost 2**: 1 týden < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce **Zbytková splatnost 3**: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok **Zbytková splatnost 4**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky **Zbytková splatnost 5**: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … **Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	Dodatelné měnové swapy se považují za nemající likvidní trh.	

▼M3

Kategorie aktiv – měnové deriváty			
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity**	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
Měnové futures (FX futures) **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = FUTR	Podkategorie měnových futures je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#13 a RTS23#47) – dvojice podkladových měn definovaná jako kombinace dvou měn tvořících podkladový nástroj derivátové smlouvy **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti futures definovaný takto: **Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 týden **Zbytková splatnost 2**: 1 týden < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce **Zbytková splatnost 3**: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok **Zbytková splatnost 4**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky **Zbytková splatnost 5**: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … **Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	Měnové futures se považují za nemající likvidní trh.	

Kategorie aktiv – měnové deriváty	
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika**
Jiné měnové deriváty Měnový derivát, který nepatří mezi žádné z výše uvedených podkategorií aktiv RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = OTHR	Jakýkoli jiný měnový derivát se považuje za nemající likvidní trh.

▼M4

Tabulka 8.2

Měnové deriváty – předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – měnové deriváty			
Podkategorie aktiv	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako nemající likvidní trh**		
	Předobchodní LIS	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Nedodatelný forward (non-deliverable forward)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Dodatelný forward (deliverable forward)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Nedodatelné měnové opce (non-deliverable FX options)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Dodatelné měnové opce (deliverable FX options)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Nedodatelné měnové swapy (non-deliverable FX swaps)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Dodatelné měnové swapy (deliverable FX swaps)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Měnové futures (FX futures)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Jiné měnové deriváty	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR

▼B

9. **Úvěrové deriváty**

▼M3

Tabulka 9.1

Úvěrové deriváty – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – úvěrové deriváty				
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.**		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Aktuální status indexu (on-the-run status)** [Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity]
Swap úvěrového selhání založený na indexu – swap, u něhož je výměna peněžních toků spojena s úvěruschopností několika emitentů finančních nástrojů tvořících index a výskytem úvěrových událostí **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	Podkategorie swapů úvěrového selhání založených na indexu je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS2#34) – podkladový index **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#42) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka derivátu **Kritérium pro segmentaci 3** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu úvěrového selhání definovaný takto: **Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok **Zbytková splatnost 2**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky **Zbytková splatnost 3**: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … **Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	200 000 000 EUR	10	Podkladový index se považuje za mající likvidní trh: 1) po celou dobu jeho „aktuálního“ (on-the-run) statusu 2) prvních 30 pracovních dní jeho „prvního neaktuálního statusu“ (1x off-the-run status) „Aktuální“ (on-the-run) index znamená právě platnou nejnovější verzi (sérii) indexu vytvořenou k datu, kdy složení indexu nabylo účinnosti, a končící jeden den před datem, kdy nabude účinnosti složení následující verze (série) indexu. „Prvním neaktuálním statusem“ (1x off-the-run status) se rozumí verze (série) indexu, která v určitém okamžiku bezprostředně předchází stávající aktuální (on-the-run) verzi (sérii). Verze (série) přestává být aktuální a získává svůj první neaktuální status v okamžiku, kdy je vytvořena nejnovější verze (série) indexu.

▼M3

Kategorie aktiv – úvěrové deriváty				
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.**		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Aktuální status indexu (on-the-run status)** [Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity]
Swap úvěrového selhání na jedno jméno – swap, u něhož je výměna peněžních toků spojena s úvěruschopností jednoho emitenta finančních nástrojů a výskytem úvěrových událostí **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	Podkategorie swapů úvěrového selhání na jedno jméno je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS2#41) – podkladový referenční subjekt **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#39) – podkladový referenční subjekt definovaný takto: „Veřejnoprávním a veřejným emitentem“ se rozumí subjekt emitenta, kterým je buď: a) Unie; b) členský stát, včetně jakéhokoli ministerstva, vládní organizace nebo zvláštní účelové jednotky členského státu; c) veřejnoprávní subjekt, který není uveden v písmenech a) a b); d) v případě federativního členského státu člen federace; e) zvláštní účelová jednotka pro několik členských států; f) mezinárodní finanční instituce zřízená dvěma nebo více členskými státy, jejímž účelem je získávat finanční prostředky a poskytovat finanční pomoc ve prospěch svých členů, kteří jsou postiženi nebo ohroženi vážnými finančními problémy;	10 000 000 EUR	10	

▼M3

Kategorie aktiv – úvěrové deriváty				
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.**		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Aktuální status indexu (on-the-run status)** [Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity]
	g) Evropská investiční banka; h) veřejný subjekt, který není veřejnoprávním emitentem, jak je uvedeno v písmenech a) až c). „Podnikovým emitentem“ se rozumí subjekt emitenta, který není veřejnoprávním a veřejným emitentem. **Kritérium pro segmentaci 3** (RTS2#42) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka derivátu **Kritérium pro segmentaci 4** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu úvěrového selhání definovaný takto: **Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok **Zbytková splatnost 2**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky **Zbytková splatnost 3**: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … **Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let			
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje následující kvalitativní kritérium likvidity**		
Opce na index swapů úvěrového selhání – opce, jejímž podkladovým nástrojem je index swapů úvěrového selhání	Podkategorie opcí na index swapů úvěrového selhání je definována následujícími kritérii pro segmentaci:	Opce na index swapů úvěrového selhání, jejímž podkladovým indexem swapů úvěrového selhání je podkategorie určená jako mající likvidní trh a jejíž čas do doby zbytkové splatnosti je 0–6 měsíců, se považuje za mající likvidní trh.		

▼M3

Kategorie aktiv – úvěrové deriváty				
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.**		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Aktuální status indexu (on-the-run status)** [Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity]
RTS2#3 = DERV **RTS2#4 = CRDT**	**Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#26) – podkategorie indexů swapů úvěrového selhání stanovená pro podkategorii swapů úvěrového selhání založených na indexu **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto: **Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců **Zbytková splatnost 2**: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok **Zbytková splatnost 3**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky **Zbytková splatnost 4**: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … **Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	Opce na index swapů úvěrového selhání, jejímž podkladovým indexem swapů úvěrového selhání je podkategorie určená jako mající likvidní trh a jejíž čas do doby zbytkové splatnosti není 0–6 měsíců, se nepovažuje za mající likvidní trh. Opce na index swapů úvěrového selhání, jejímž podkladovým indexem swapů úvěrového selhání je podkategorie určená jako nemající likvidní trh, se pro jakýkoli čas do doby zbytkové splatnosti považuje za nemající likvidní trh.		
Opce na swap úvěrového selhání na jedno jméno – opce, jejímž podkladovým nástrojem je swap úvěrového selhání na jedno jméno **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	Podkategorie opcí na swapy úvěrového selhání na jedno jméno je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS23#26) – podkategorie swapů úvěrového selhání na jedno jméno stanovená pro tuto podkategorii aktiv	Opce na swap úvěrového selhání na jedno jméno, jejímž podkladovým swapem úvěrového selhání na jedno jméno je podkategorie určená jako mající likvidní trh a jejíž čas do doby zbytkové splatnosti je 0–6 měsíců, se považuje za mající likvidní trh. Opce na swap úvěrového selhání na jedno jméno, jejímž podkladovým swapem úvěrového selhání na jedno jméno je podkategorie určená jako mající likvidní trh a jejíž čas do doby zbytkové splatnosti není 0–6 měsíců, se nepovažuje za mající likvidní trh.		

▼M3

Kategorie aktiv – úvěrové deriváty				
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.**		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]	**Aktuální status indexu (on-the-run status)** [Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity]
	Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto: **Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců **Zbytková splatnost 2**: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok **Zbytková splatnost 3**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky **Zbytková splatnost 4**: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … **Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	Opce na swap úvěrového selhání na jedno jméno, jejímž podkladovým swapem úvěrového selhání na jedno jméno je podkategorie určená jako nemající likvidní trh, se pro jakýkoli čas do doby zbytkové splatnosti považuje za nemající likvidní trh.		

Kategorie aktiv – úvěrové deriváty	
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika**
Jiné úvěrové deriváty – úvěrový derivát, který nepatří mezi žádné z výše uvedených podkategorií aktiv **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT** RTS2#5 = OTHR	Jakýkoli jiný úvěrový derivát se považuje za nemající likvidní trh.

▼M4

Tabulka 9.2

Úvěrové deriváty – předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako mající likvidní trh

Kategorie aktiv – úvěrové deriváty									
Podkategorie aktiv	**Percentily a spodní hranice prahových hodnot, které se použijí pro výpočet předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS pro podkategorie určené jako mající likvidní trh**								
	Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot	**Předobchodní LIS**		**Poobchodní SSTI**			**Poobchodní LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**
Swap úvěrového selhání založený na indexu	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Swap úvěrového selhání na jedno jméno	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Opce na index swapů úvěrového selhání	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – úvěrové deriváty									
Podkategorie aktiv	**Percentily a spodní hranice prahových hodnot, které se použijí pro výpočet předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS pro podkategorie určené jako mající likvidní trh**								
	Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot	**Předobchodní LIS**		**Poobchodní SSTI**			**Poobchodní LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**
Opce na swapy úvěrového selhání na jedno jméno	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

Tabulka 9.3

Úvěrové deriváty – předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – úvěrové deriváty			
Podkategorie aktiv	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako nemající likvidní trh**		
	Předobchodní LIS	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Swap úvěrového selhání založený na indexu	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Swap úvěrového selhání na jedno jméno	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Opce na index swapů úvěrového selhání	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Opce na swapy úvěrového selhání na jedno jméno	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Jiné úvěrové deriváty	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR

▼B

10. **Deriváty C10**

▼M3

Tabulka 10.1

Deriváty C10 – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – deriváty C10			
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity**	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
Deriváty týkající se sazeb přepravného Finanční nástroj týkající se sazeb přepravného ve smyslu přílohy I oddílu C bodu 10 směrnice 2014/65/EU RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „FRGT“	Podkategorie derivátů týkajících se přepravného je definována následujícími kritérii pro segmentaci: **Kritérium pro segmentaci 1** (RTS2#5) – typ smlouvy: futures nebo opce **Kritérium pro segmentaci 2** (RTS23#36) – druh přepravy **Kritérium pro segmentaci 3** (RTS2#37) – podtyp přepravy **Kritérium pro segmentaci 4** (RTS2#12) – specifikace velikosti podtypu přepravy **Kritérium pro segmentaci 5** (RTS2#13) – konkrétní trasa nebo průměr časového pronájmu **Kritérium pro segmentaci 6** (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti derivátu definovaný takto: **Zbytková splatnost 1**: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc **Zbytková splatnost 2**: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce **Zbytková splatnost 3**: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců **Zbytková splatnost 4**: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 9 měsíců **Zbytková splatnost 5**: 9 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok **Zbytková splatnost 6**: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	10 000 000 EUR	10

▼M3

Kategorie aktiv – deriváty C10			
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity**	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	Zbytková splatnost 7: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky … **Zbytková splatnost m**: (n–1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let		

Kategorie aktiv – deriváty C10	
Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika**
Jiné deriváty C10 Finanční nástroj ve smyslu přílohy I oddílu C bodu 10 směrnice 2014/65/EU, který není derivátem týkajícím se sazeb přepravného, jakákoli z těchto podkategorií úrokových derivátů: inflační měnový swap více měn, futures/forward na inflační měnové swapy více měn, inflační měnový swap jedné měny, futures/forward na inflační měnový swap jedné měny, a jakákoli z těchto podkategorií akciových derivátů: opce na index volatility, futures/forward na index volatility, swap s parametrem variance výnosnosti, swap s parametrem volatility výnosnosti, portfoliový swap s parametrem variance výnosnosti, portfoliový swap s parametrem volatility výnosnosti.	Jakýkoli jiný derivát C10 se považuje za nemající likvidní trh.

▼M4

Tabulka 10.2

Deriváty C10 – předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako mající likvidní trh

Kategorie aktiv – deriváty C10									
Podkategorie aktiv	**Percentily a spodní hranice prahových hodnot, které se použijí pro výpočet předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS pro podkategorie určené jako mající likvidní trh**								
	Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot	**Předobchodní LIS**		**Poobchodní SSTI**			**Poobchodní LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**
Deriváty týkající se sazeb přepravného	výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených za použití finančních nástrojů spadajících do dané podkategorie	70	50 000 EUR	80	60	75 000 EUR	90	70	100 000 EUR

Tabulka 10.3

Deriváty C10 – předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – deriváty C10			
Podkategorie aktiv	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako nemající likvidní trh**		
	Předobchodní LIS	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Deriváty týkající se sazeb přepravného	50 000 EUR	75 000 EUR	100 000 EUR
Jiné deriváty C10	50 000 EUR	75 000 EUR	100 000 EUR

▼B

11. **Finanční rozdílové smlouvy (CFD)**

▼M3

Tabulka 11.1

Finanční rozdílové smlouvy – kategorie nemající likvidní trh

Podkategorie aktiv	**Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.**	Kvalitativní kritérium likvidity	**Průměrná denní pomyslná částka (ADNA)** [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
Měnové finanční rozdílové smlouvy RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = CURR	Podkategorie měnových finančních rozdílových smluv je definována dvojicí podkladových měn definovaných jako kombinace dvou měn tvořících podkladový nástroj finanční rozdílové smlouvy / smlouvy týkající se sázek na rozpětí. RTS2#30 a RTS2#31		50 000 000 EUR	100
Komoditní finanční rozdílové smlouvy RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = COMM	Podkategorie komoditních finančních rozdílových smluv je definována podkladovou komoditou finanční rozdílové smlouvy / smlouvy týkající se sázek na rozpětí. RTS23#35 a RTS23#36 a RTS23#37		50 000 000 EUR	100
Akciové finanční rozdílové smlouvy RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = EQUI	Podkategorie akciových finančních rozdílových smluv je definována podkladovými kapitálovými cennými papíry finanční rozdílové smlouvy / smlouvy týkající se sázek na rozpětí. RTS23#26	Podkategorie akciových finančních rozdílových smluv se považuje za mající likvidní trh, jsou-li podkladovým nástrojem kapitálové cenné papíry, pro které existuje likvidní trh určený v souladu s čl. 2 odst. 1 bodem 17 písm. b) nařízení (EU) č. 600/2014.		
Dluhopisové finanční rozdílové smlouvy RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = BOND	Podkategorie dluhopisových finančních rozdílových smluv je definována podkladovým dluhopisem nebo dluhopisovým futures finanční rozdílové smlouvy / smlouvy týkající se sázek na rozpětí. RTS23#26	Podkategorie dluhopisových finančních rozdílových smluv se považuje za mající likvidní trh, je-li podkladovým nástrojem dluhopis nebo dluhopisový futures, pro který existuje likvidní trh určený v souladu s článkem 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b).		

▼M3

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Kvalitativní kritérium likvidity	Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
Finanční rozdílové smlouvy týkající se akciových futures/forwardů RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = FTEQ	Podkategorie finančních rozdílových smluv týkajících se akciových futures/forwardů je definována podkladovými akciovými futures/forwardy finanční rozdílové smlouvy / smlouvy týkající se sázek na rozpětí. RTS23#26	Podkategorie finančních rozdílových smluv týkajících se akciových futures/forwardů se považuje za mající likvidní trh, jsou-li podkladovým nástrojem akciové futures/forwardy, pro které existuje likvidní trh určený v souladu s článkem 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b).		
Rozdílové finanční smlouvy týkající se opce na akcie RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OPEQ	Podkategorie finančních rozdílových smluv týkajících se opce na akcie je definována podkladovou opcí na akcie finanční rozdílové smlouvy / smlouvy týkající se sázek na rozpětí. RTS23#26	Podkategorie finančních rozdílových smluv týkajících se akciových opcí se považuje za mající likvidní trh, je-li podkladovým nástrojem akciová opce, pro kterou existuje likvidní trh určený v souladu s článkem 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b).		

Kategorie aktiv – finanční rozdílové smlouvy

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika
Jiné finanční rozdílové smlouvy	
Finanční rozdílová smlouva / sázka na rozpětí, které nepatří mezi žádné z výše uvedených podkategorií aktiv RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OTHR	Jakákoli jiná finanční rozdílová smlouva / sázka na rozpětí se považuje za nemající likvidní trh.

▼M4

Tabulka 11.2

Finanční rozdílové smlouvy – předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako mající likvidní trh

Kategorie aktiv – finanční rozdílové smlouvy									
Podkategorie aktiv	**Percentily a spodní hranice prahových hodnot, které se použijí pro výpočet předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS pro podkategorie určené jako mající likvidní trh**								
	Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot	**Předobchodní LIS**		**Poobchodní SSTI**			**Poobchodní LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**
Měnové finanční rozdílové smlouvy	obchody provedené v souvislosti s měnovými finančními rozdílovými smlouvami považovanými za mající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b)	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Komoditní finanční rozdílové smlouvy	obchody provedené v souvislosti s komoditními finančními rozdílovými smlouvami považovanými za mající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b)	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Akciové finanční rozdílové smlouvy	obchody provedené v souvislosti s akciovými finančními rozdílovými smlouvami považovanými za mající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b)	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Dluhopisové finanční rozdílové smlouvy	obchody provedené v souvislosti s akciovými finančními rozdílovými smlouvami považovanými za mající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b)	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – finanční rozdílové smlouvy									
Podkategorie aktiv	**Percentily a spodní hranice prahových hodnot, které se použijí pro výpočet předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS pro podkategorie určené jako mající likvidní trh**								
	Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot	**Předobchodní LIS**		**Poobchodní SSTI**			**Poobchodní LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**
Finanční rozdílové smlouvy týkající se akciových futures/ forwardů	obchody provedené v souvislosti s finančními rozdílovými smlouvami týkajícími se akciových futures považovanými za mající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b)	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Finanční rozdílové smlouvy týkající se opce na akcie	obchody provedené v souvislosti s finančními rozdílovými smlouvami týkajícími se opce na akcie považovanými za mající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b)	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR

Tabulka 11.3

Finanční rozdílové smlouvy – předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – finanční rozdílové smlouvy			
Podkategorie aktiv	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako nemající likvidní trh**		
	Předobchodní LIS	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Měnové finanční rozdílové smlouvy	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Komoditní finanční rozdílové smlouvy	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

▼M4

Kategorie aktiv – finanční rozdílové smlouvy			
Podkategorie aktiv	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako nemající likvidní trh**		
	Předobchodní LIS	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Akciové finanční rozdílové smlouvy	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Dluhopisové finanční rozdílové smlouvy	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Finanční rozdílové smlouvy týkající se akciových futures/forwardů	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Finanční rozdílové smlouvy týkající se opce na akcie	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Jiné finanční rozdílové smlouvy / sázky na rozpětí	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

12. **Povolenky na emise**

Tabulka 12.1

Povolenky na emise – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – povolenky na emise	
Pro účely určení podkategorií aktiv nemajících likvidní trh podle článku 6a se použije následující metodika:	
Podkategorie aktiv	**Určení likvidity**
Povolenky na emise (EUA) – jakýkoli nástroj, který se považuje za nástroj splňující požadavky směrnice Evropského parlamentu a Rady 2003/87/ES [1] (systém obchodování s emisemi) a který představuje právo vypustit ekvivalent jedné tuny ekvivalentu oxidu uhličitého (tCO_2e) RTS2#3 = EMAL and RTS23#37 = EUAE	Povolenky na emise (EUA) se považují za mající likvidní trh
Jakékoli jiné povolenky na emise RTS2#3 = EMAL a RTS23#37 <> EUAE	Jakékoli jiné povolenky na emise se považují za nemající likvidní trh

[1] Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2003/87/ES ze dne 13. října 2003 o vytvoření systému pro obchodování s povolenkami na emise skleníkových plynů ve Společenství a o změně směrnice Rady 96/61/ES (Úř. věst. L 275, 25.10.2003, s. 32, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2003/87/oj).

▼M4

Tabulka 12.2

Povolenky na emise – předobchodní prahová hodnota LIS a poobchodní prahová hodnota pro daný objem

Kategorie aktiv – povolenky na emise		
Podkategorie aktiv	**Předobchodní LIS**	**Poobchodní prahová hodnota pro daný objem**
Povolenky na emise (EUA)	5 000 tun ekvivalentu oxidu uhličitého	25 000 tun ekvivalentu oxidu uhličitého
Jakékoli jiné povolenky na emise	jakýkoli objem	jakýkoli objem

▼B

13. **Deriváty povolenek na emise**

▼M3

Tabulka 13.1

Deriváty povolenek na emise – kategorie nemající likvidní trh

	Kategorie aktiv – deriváty povolenek na emise	
Podkategorie aktiv	**Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity**	
	Průměrná denní částka (ADA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
Deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou povolenky na emise (EUA) Finanční nástroj týkající se povolenek na emise typu povolenky na emise (EUA) ve smyslu přílohy I oddílu C bodu 4 směrnice 2014/65/EU RTS2#3 = DERV a RTS2#4 = EMAL a RTS2#43 = EUAE	150 000 tun ekvivalentu oxidu uhličitého	5

▼M3

Podkategorie aktiv	Kategorie aktiv – deriváty povolenek na emise	
	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity	
	Průměrná denní částka (ADA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	**Průměrný denní počet obchodů** [kvantitativní kritérium likvidity 2]
Deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou povolenky pro letectví (EUAA) Finanční nástroj týkající se povolenek na emise typu povolenky pro letectví (EUAA) ve smyslu přílohy I oddílu C bodu 4 směrnice 2014/65/EU RTS2#3 = DERV a RTS2#4 = EMAL a RTS2#43 = EUAA	150 000 tun ekvivalentu oxidu uhličitého	5
Deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou ověřená snížení emisí (CER) Finanční nástroj týkající se povolenek na emise typu ověřeného snížení emisí (CER) ve smyslu přílohy I oddílu C bodu 4 směrnice 2014/65/EU RTS2#3 = DERV a RTS2#4 = EMAL a RTS2#43 = CERE	150 000 tun ekvivalentu oxidu uhličitého	5
Deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou jednotky snížení emisí (ERU) Finanční nástroj týkající se povolenek na emise typu jednotky snížení emisí (ERU) ve smyslu přílohy I oddílu C bodu 4 směrnice 2014/65/EU RTS2#3 = DERV a RTS2#4 = EMAL a RTS2#43 = ERUE	150 000 tun ekvivalentu oxidu uhličitého	5
Jiné deriváty povolenek na emise Derivát povolenek na emise, jehož podkladovým nástrojem je povolenka na emise, která se považuje za povolenku na emise splňující požadavky směrnice 2003/87/ES (systém obchodování s emisemi) a která není povolenkou na emise EU (EUA), povolenkou pro letectví (EUAA), ověřeným snížením emisí (CER), ani jednotkou snížení emisí (ERU) RTS2#3 = DERV a RTS2#4 = EMAL a RTS2#43 = OTHR	Jakýkoli jiný derivát povolenek na emise se považuje za nemající likvidní trh.	

▼M4

Tabulka 13.2

Deriváty povolenek na emise – předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie aktiv určené jako mající likvidní trh

Kategorie aktiv – deriváty povolenek na emise							
Podkategorie aktiv	**Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot**	**Percentily a spodní hranice prahové hodnoty, které se použijí pro výpočet předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS pro podkategorie aktiv určené jako mající likvidní trh**					
		Předobchodní LIS		**Poobchodní SSTI**		**Poobchodní LIS**	
		Obchod – percentil	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**
Deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou povolenky na emise (EUA)	obchody uskutečněné v souvislosti se všemi deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou povolenky na emise (EUA)	70	50 000 tun oxidu uhličitého	80	90 000 tun oxidu uhličitého	90	100 000 tun oxidu uhličitého
Deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou povolenky pro letectví (EUAA)	obchody uskutečněné v souvislosti se všemi deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou povolenky pro letectví (EUAA)	70	25 000 tun oxidu uhličitého	80	40 000 tun oxidu uhličitého	90	50 000 tun oxidu uhličitého
Deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou ověřená snížení emisí (CER)	obchody uskutečněné v souvislosti se všemi deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou ověřená snížení emisí (CER)	70	25 000 tun oxidu uhličitého	80	40 000 tun oxidu uhličitého	90	50 000 tun oxidu uhličitého

▼M4

Kategorie aktiv – deriváty povolenek na emise							
Podkategorie aktiv	**Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot**	**Percentily a spodní hranice prahové hodnoty, které se použijí pro výpočet předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS pro podkategorie aktiv určené jako mající likvidní trh**					
		Předobchodní LIS		**Poobchodní SSTI**		**Poobchodní LIS**	
		Obchod – percentil	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**	**Obchod – percentil**	**Spodní hranice prahové hodnoty**
Deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou jednotky snížení emisí (ERU)	obchody uskutečněné v souvislosti se všemi deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou jednotky snížení emisí (ERU)	70	25 000 tun oxidu uhličitého	80	40 000 tun oxidu uhličitého	90	50 000 tun oxidu uhličitého

Tabulka 13.3

Deriváty povolenek na emise – předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie aktiv určené jako nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – deriváty povolenek na emise			
Podkategorie aktiv	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie aktiv určené jako nemající likvidní trh**		
	Předobchodní LIS	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou povolenky na emise (EUA)	50 000 tun oxidu uhličitého	90 000 tun oxidu uhličitého	100 000 tun oxidu uhličitého
Deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou povolenky pro letectví (EUAA)	25 000 tun oxidu uhličitého	40 000 tun oxidu uhličitého	50 000 tun oxidu uhličitého

▼M4

Kategorie aktiv – deriváty povolenek na emise			
Podkategorie aktiv	**Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie aktiv určené jako nemající likvidní trh**		
	Předobchodní LIS	**Poobchodní SSTI**	**Poobchodní LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou ověřená snížení emisí (CER)	25 000 tun oxidu uhličitého	40 000 tun oxidu uhličitého	50 000 tun oxidu uhličitého
Deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou jednotky snížení emisí (ERU)	25 000 tun oxidu uhličitého	40 000 tun oxidu uhličitého	50 000 tun oxidu uhličitého
Jiné deriváty povolenek na emise	25 000 tun oxidu uhličitého	40 000 tun oxidu uhličitého	50 000 tun oxidu uhličitého

▼B

PŘÍLOHA IV

Referenční údaje, které mají být poskytnuty pro účely výpočtů transparentnosti

▼M3
▼C1

Tabulka 1

Tabulka symbolů pro tabulku 2

SYMBOL	TYP DAT	DEFINICE
{ALPHANUM-n}	Až n alfanumerických znaků	Volný text
{DECIMAL-n/m}	Až n-místné desetinné číslo, z čehož až m míst může být zlomková část	Numerické pole pro kladné i záporné hodnoty: 1. desetinný oddělovač je „.“ (tečka); 2. před číslem může být znaménko „–“ (minus) pro označení záporných čísel. Hodnoty se případně zaokrouhlují, nikoli zkracují.
{COUNTRYCODE_2}	2 alfanumerické znaky	Kód země ze dvou písmen podle kódu země ISO 3166-1 alpha-2
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerické znaky	Kód měny ze tří písmen podle kódů měn ISO 4217
{DATEFORMAT}	Formát data podle ISO 8601	Formátování dat: RRRR-MM-DD
{ISIN}	12 alfanumerických znaků	Kód ISIN ve smyslu normy ISO 6166
{LEI}	20 alfanumerických znaků	Identifikátor právnické osoby ve smyslu normy ISO 17442
{MIC}	4 alfanumerické znaky	Identifikační kód trhu ve smyslu normy ISO 10383
{EIC}	16 alfanumerických znaků	Kód EIC vztahující se k místu dodání v Evropské unii nebo mimo ni
{INDEX}	4 alfabetické znaky	„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

▼C1

SYMBOL	TYP DAT	DEFINICE
		„CIBO“ – CIBOR „MOSP“ – MOSPRIM „NIBO“ – NIBOR „PRBO“ – PRIBOR „TLBO“ – TELBOR „WIBO“ – WIBOR „TREA“ – Státní pokladniční poukázky „SWAP“ – Swapy „FUSW“ – Termínované swapy

▼M3

Tabulka 2

Podrobnosti o referenčních údajích, které mají být poskytnuty pro účely výpočtů transparentnosti

Č.	POLE	PODROBNOSTI, KTERÉ SE MAJÍ VYKAZOVAT	FORMÁT PRO PODÁVÁNÍ ZPRÁV
1	Identifikační kód nástroje	Kód k identifikaci finančního nástroje	{ISIN}
2	Úplný název nástroje	Úplný název finančního nástroje	{ALPHANUM-350}
3	Identifikační kód MiFIR	**Identifikace nekapitálových finančních nástrojů:** **Sekuritizované deriváty** ve smyslu tabulky 4.1 v oddíle 4 přílohy III **Strukturované finanční produkty** ve smyslu čl. 2 odst. 1 bodu 28 nařízení (EU) č. 600/2014 **Dluhopisy (pro všechny dluhopisy s výjimkou ETC a ETN)** ve smyslu čl. 4 odst. 1 bodu 44 písm. b) směrnice 2014/65/EU **ETC** ve smyslu čl. 4 odst. 1 bodu 44 písm. b) směrnice 2014/65/EU a dalšího upřesnění v tabulce 2.4 oddílu 2 přílohy III **ETN** ve smyslu čl. 4 odst. 1 bodu 44 písm. b) směrnice 2014/65/EU a dalšího upřesnění v tabulce 2.4 oddílu 2 přílohy III **Povolenky na emise** ve smyslu tabulky 12.1 oddílu 12 přílohy III **Deriváty** ve smyslu přílohy I oddílu C bodů 4 až 10 směrnice 2014/65/EU	**Nekapitálové finanční nástroje:** „SDRV“ – sekuritizované deriváty „SFPS“ – strukturované finanční produkty „BOND“ – dluhopisy „ETCS“ – ETC „ETNS“ – ETN „EMAL“ – povolenky na emise „DERV“ – deriváty

▼M3

Č.	POLE	PODROBNOSTI, KTERÉ SE MAJÍ VYKAZOVAT	FORMÁT PRO PODÁVÁNÍ ZPRÁV
4	Kategorie aktiv podkladového nástroje	Vyplní se, je-li identifikační kód MiFIR sekuritizovaný derivát nebo derivát.	„INTR“ – úroková sazba „EQUI“ – kapitál „COMM“ – komodity „CRDT“ – úvěr „CURR“ – měna „EMAL“ – povolenky na emise „OCTN“ – jiné C10
5	Typ smlouvy	Vyplní se, je-li identifikační kód MiFIR derivát.	„OPTN“ – opce „FUTR“ – futures (včetně dohod o sazbách přepravného (FFA)) „FRAS“ – dohoda o forwardových úrokových mírách (FRA) „FORW“ – forwardy „SWAP“ – swapy „PSWP“ – portfoliové swapy „SWPT“ – swapce „OPTS“ – opce na swapy „FONS“ – futures na swapy „FWOS“ – forwardy na swapy „SPDB“ – sázky na rozpětí „CFDS“ – finanční rozdílové smlouvy „OTHR“ – jiné
6	Den vykazování	Den, pro který jsou poskytnuty referenční údaje	{DATEFORMAT}
7	Obchodní systém	MIC segmentu obchodního systému, existuje-li, jinak operační MIC.	{MIC}
8	Splatnost	Definovaná splatnost finančního nástroje. Pole se použije pro tyto kategorie aktiv: dluhopisy, úrokové deriváty, akciové deriváty, komoditní deriváty, měnové deriváty, úvěrové deriváty, deriváty C10 a deriváty povolenek na emise.	{DATEFORMAT}

Pole týkající se dluhopisů (všech druhů dluhopisů s výjimkou ETC a ETN)

Pole v tomto oddíle se vyplňují pouze pro dluhopisy ve smyslu tabulky 2.1 v oddíle 2 přílohy III

9	Druh dluhopisu	Druh dluhopisu ve smyslu tabulky 2.2 oddílu 2 přílohy III. Vyplní se, pouze je-li identifikační kód MiFIR dluhopis.	„EUSB“ – státní dluhopisy „OEPB“ – jiné veřejné dluhopisy „CVTB“ – konvertibilní dluhopisy „CVDB“ – kryté dluhopisy „CRPB“ – podnikové dluhopisy „OTHR“ – jiné

▼M3

10	Datum emise	Datum, kdy je dluhopis emitován a začne nabíhat úrok.	{DATEFORMAT}

Pole týkající se povolenek na emise

Pole v tomto oddíle se vyplňují pouze pro povolenky na emise ve smyslu tabulky 12.1 v oddíle 12 přílohy III

11	Podtyp povolenek na emise	Povolenky na emise	„CERE“ – CER „ERUE“ – ERU „EUAE“ – EUA „EUAA“ – EUAA „OTHR“ – jiné

Pole týkající se derivátů

Komoditní deriváty a deriváty C10

Pole v tomto oddíle se vyplňují pouze pro komoditní deriváty ve smyslu tabulky 7.1 oddílu 7 přílohy III a pro deriváty C10 ve smyslu tabulky 10.1 oddílu 10 přílohy III

12	Specifikace velikosti podtypu přepravy	Vyplní se, je-li jako základní produkt uvedený v tabulce 2 poli 35 přílohy nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/585 uvedena přeprava.	Pro přepravu po souši: „CAPE“ – Capesize „PNMX“ – Panamax „SPMX“ – Supramax „HAND“ – Handysize Pro přepravu po vodě: „CLAN“ – čistá „DRTY“ – hrubá {ALPHANUM-4} jinak
13	Konkrétní trasa nebo průměr časového pronájmu	Vyplní se, je-li jako základní produkt uvedený v tabulce 2 poli 35 přílohy nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/585 uvedena přeprava.	Pro přepravu po vodě: „TD7“ – TD7 „TD8“ – TD8 „TD17“ – TD17 „TD19“ – TD19 „TD20“ – TD20 „BLPG1“ – BLPG1 „TD3C“ – TD3C „TC2“ – TC2 „TC2_37“ – TC2_37 „TD3“ – TD3 „TC5“ – TC5 „TC6“ – TC6 „TC7“ – TC7 „TC9“ – TC9 „TC12“ – TC12 „TC14“ – TC14 „TC15“ – TC15

▼M3

			Pro přepravu po souši: „4TC“ – 4TC „5TC“ – 5TC „6TC“ – 6TC „10TC“ – 10TC „C3“ – C3 „C5“ – C5 „C7“ – C7 „P1A“ – P1A „P2A“ – P2A „P3A“ – P3A „P1E“ – P1E „P2E“ – P2E „P3E“ – P3E {ALPHANUM-6} jinak
14	Místo dodání/hotovostního vypořádání	Vyplní se, je-li jako základní produkt uvedený v tabulce 2 poli 35 přílohy nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/585 uvedena energie.	{EIC} pro elektřinu nebo zemní plyn „OTHR“ – jiné
15	Jmenovitá měna	Měna, v níž je denominována jmenovitá částka.	{CURRENCYCODE_3}

Úrokové deriváty

Pole v tomto oddíle se vyplňují pouze pro úrokové deriváty ve smyslu přílohy III oddílu 5 tabulky 5.1

16	Druh podkladového nástroje	Vyplní se pro typ smlouvy jiný než swapy, swapce, futures na swapy a forwardy na swapy, a to jednou z následujících možností ********** Vyplní se pro typ smlouvy swapy, swapce, opce na swapy, futures na swapy a forwardy na swapy, a to s ohledem na podkladový swap jednou z následujících možností	„BOND“ – dluhopisy „BNDF“ – dluhopisové futures „INTR“ – úroková sazba „IFUT“ – úrokové futures ********** „FFMC“ – měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami (float-to-float multi-currency swaps) „XFMC“ – měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měny s pevnou úrokovou sazbou a měny s pohyblivou úrokovou sazbou (fixed-to-float multi-currency swaps) „XXMC“ – měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami (fixed-to-fixed multi-currency swaps) „OSMC“ – swapy více měn na bázi OIS (OIS multi-currency swaps) „IFMC“ – inflační měnové swapy více měn (inflation multi-currency swaps) „FFSC“ – měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami (float-to-float single-currency swaps) „XFSC“ – měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měny s pevnou úrokovou sazbou a měny s pohyblivou úrokovou sazbou (fixed-to-float single-currency swaps)

▼M3

			„XXSC“ – měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami (fixed-to-fixed single-currency swaps) „OSSC“ – swapy jedné měny na bázi OIS (OIS single-currency swaps) „IFSC“ – inflační měnové swapy jedné měny (inflation single-currency swaps)
17	Emitent podkladového dluhopisu	Je-li podkladovým nástrojem dluhopis nebo dluhopisové future, vyplní se kódem identifikátoru právnické osoby (LEI) emitenta přímého nebo hlavního podkladového dluhopisu.	{LEI}
18	Datum splatnosti podkladového dluhopisu	Vyplní se datem definované splatnosti podkladového dluhopisu.	{DATEFORMAT}
19	Datum emise podkladového dluhopisu	Vyplní se datem emise podkladového dluhopisu.	{DATEFORMAT}
20	Jmenovitá měna swapce	Vyplní se pouze pro swapce	{CURRENCYCODE_3}
21	Splatnost podkladového swapu	Vyplní se pouze pro swapce, opce na swapy, futures na swapy a forwardy na swapy	{DATEFORMAT}
22	Kód ISIN indexu inflace / kód ISIN podkladového dluhopisu	V případě swapcí týkajících se jednoho z následujících druhů podkladových swapů: inflační měnový swap jedné měny, futures/forwardy na inflační měnový swap jedné měny, inflační měnový swap více měn, futures/forwardy na inflační měnový swap více měn; má-li index inflace ISIN, vyplní se pole kódem ISIN pro daný index. ********** V případě dluhopisových opcí / opcí na dluhopisovou opci / opcí na dluhopisový futures musí být v poli vyplněn kód ISIN hlavního podkladového dluhopisu.	{ISIN} ********** {ISIN}

▼M3

23	Název indexu inflace	V případě swapcí týkajících se jednoho z následujících druhů podkladových swapů se pole vyplní standardizovaným názvem indexu: inflační měnový swap jedné měny, futures/forwardy na inflační měnový swap jedné měny, inflační měnový swap více měn, futures/forwardy na inflační měnový swap více měn.	{ALPHANUM-25}
24	Referenční sazba	Název referenční sazby.	{INDEX} nebo {ALPHANUM-25} – pokud není referenční sazba zahrnuta do seznamu {INDEX}
25	Doba trvání podkladové úrokové sazby	V tomto poli se uvádí doba trvání úrokové sazby, která je podkladem smlouvy. Doba se vyjádří v dnech, týdnech, měsících nebo letech. Začíná se od největší jednotky doby trvání (roky) a postupuje se směrem dolů; pokud je doba trvání úrokové sazby celým číslem, je tato standardní doba trvání vyplněna v tomto poli.	{INTEGER-3}+„DAYS“ – dny {INTEGER-3}+„WEEK“ – týdny {INTEGER-3}+„MNTH“ – měsíce {INTEGER-3}+„YEAR“ – roky

Měnové deriváty

Pole v tomto oddíle se vyplňují pouze pro měnové deriváty ve smyslu tabulky 8.1 oddílu 8 přílohy III

26	Podtyp smlouvy	Vyplní se tak, aby se odlišily dodatelné a nedodatelné forwardy, opce a swapy, jak jsou uvedeny v tabulce 8.1 oddílu 8 přílohy III.	„DLVR“ – dodatelný (deliverable) „NDLV“ – nedodatelný (non-deliverable)

Akciové deriváty

Pole v tomto oddíle se vyplňují pouze pro akciové deriváty ve smyslu tabulky 6.1 oddílu 6 přílohy III`

27	Druh podkladového nástroje	Vyplní se, je-li identifikačním kódem MiFIR derivát, kategorií aktiv podkladového nástroje akcie a podkategorií aktiv nejsou ani swapy, ani portfoliové swapy.	„STIX“ – akciový index „SHRS“ – akcie „DIVI“ – dividendový index „DVSE“ – akciová dividenda „BSKT“ – koš akcií vyplývající z podnikových opatření „ETFS“ – fondy obchodované v obchodním systému „VOLI“ – index volatility „OTHR“ – jiné (včetně cenných papírů nahrazujících jiné cenné papíry, certifikátů a jiných finančních nástrojů podobných kapitálovým)

▼M3

		********** Vyplní se, je-li identifikačním kódem MiFIR derivát, kategorií aktiv podkladového nástroje akcie a podkategorií aktiv jsou buď swapy, nebo portfoliové swapy a kritériem pro segmentaci 2 ve smyslu tabulky 6.1 oddílu 6 přílohy III je jedno jméno.	********** „SHRS“ – akcie „DVSE“ – akciová dividenda „ETFS“ – fondy obchodované v obchodním systému „OTHR“ – jiné (včetně cenných papírů nahrazujících jiné cenné papíry, certifikátů a jiných finančních nástrojů podobných kapitálovým)
		********** Vyplní se, je-li identifikačním kódem MiFIR derivát, kategorií aktiv podkladového nástroje akcie a podkategorií aktiv jsou buď swapy, nebo portfoliové swapy a kritériem pro segmentaci 2 ve smyslu tabulky 6.1 oddílu 6 přílohy III je index.	********** „STIX“ – akciový index „DIVI“ – dividendový index „VOLI“ – index volatility „OTHR“ – jiné
		********** Vyplní se, je-li identifikačním kódem MiFIR derivát, kategorií aktiv podkladového nástroje akcie a podkategorií aktiv jsou buď swapy, nebo portfoliové swapy a kritériem pro segmentaci 2 ve smyslu tabulky 6.1 oddílu 6 přílohy III je koš.	********** „BSKT“ – koš
28	Parametr	Vyplní se, je-li identifikačním kódem MiFIR derivát, kategorií aktiv podkladového nástroje akcie a podkategorií aktiv jedna z následujících možností: swapy, portfoliové swapy.	„PRBP“ – parametr výnosnosti základního vývoje „PRDV“ – parametr výnosnosti dividend „PRVA“ – parametr variance výnosnosti „PRVO“ – parametr volatility výnosnosti

Finanční rozdílové smlouvy

Tato pole se vyplní, pouze je-li typem smlouvy rozdílová smlouva nebo sázka na rozpětí.

29	Druh podkladového nástroje	Vyplní se, je-li identifikačním kódem MiFIR derivát a typem smlouvy rozdílová smlouva nebo sázka na rozpětí.	„CURR“ – měna „EQUI“ – kapitál „BOND“ – dluhopisy „FTEQ“ – akciové futures/forwardy „OPEQ“ – opce na akcie „COMM“ – komodita „EMAL“ – povolenky na emise „OTHR“ – jiné

▼M3

30	Jmenovitá měna 1	První měna podkladové dvojice měn. Pole se použije, je-li druhem podkladového nástroje měna.	{CURRENCYCODE_3}
31	Jmenovitá měna 2	Druhá měna podkladové dvojice měn. Pole se použije, je-li druhem podkladového nástroje měna.	{CURRENCYCODE_3}

Úvěrové deriváty

Pole v tomto oddíle se vyplňují pouze pro úvěrové deriváty ve smyslu tabulky 9.1 oddílu 9 přílohy III

32	Kód ISIN podkladového swapu úvěrového selhání	Vyplní se pro deriváty na swapy úvěrového selhání, a to kódem ISIN podkladového swapu.	{ISIN}
33	Kód podkladového indexu	Vyplní se pro deriváty na index swapů úvěrového selhání, a to kódem ISIN indexu.	{ISIN}
34	Název podkladového indexu	Vyplní se pro deriváty na index swapů úvěrového selhání, a to standardizovaným názvem indexu.	{ALPHANUM-25}
35	Série	Případně číslo série složení indexu. Vyplní se pro index swapů úvěrového selhání nebo pro derivát na index swapů úvěrového selhání, a to číslem série tohoto indexu.	{DECIMAL-18/17}
36	Verze	Nová verze série se vydá, pokud jedna ze složek selže a index musí být nově vyvážen, aby se zohlednil nový celkový počet složek indexu. Vyplní se pro index swapů úvěrového selhání nebo pro derivát na index swapů úvěrového selhání, a to uvedením verze tohoto indexu.	{DECIMAL-18/17}
37	Měsíce rolování indexu (roll months)	Všechny měsíce, kdy se očekává rolování indexu, jak bylo stanoveno poskytovatelem indexu pro daný rok. Pole se zopakuje pro každý měsíc rolování. Vyplní se pro index swapů úvěrového selhání nebo pro derivát na index swapů úvěrového selhání.	„01“, „02“, „03“, „04“, „05“, „06“, „07“, „08“, „09“, „10“, „11“, „12“
38	Datum příštího rolování (next roll date)	Vyplní se pro index swapů úvěrového selhání nebo pro derivát na index swapů úvěrového selhání, a to datem příštího rolování, jak bylo stanoveno poskytovatelem indexu.	{DATEFORMAT}
39	Veřejnoprávní a veřejný emitent	Vyplní se, je-li referenčním subjektem swapu úvěrového selhání na jedno jméno nebo derivátu na swap úvěrového selhání na jedno jméno veřejnoprávní emitent ve smyslu tabulky 9.1 oddílu 9 přílohy III.	„TRUE“ – referenčním subjektem je veřejnoprávní a veřejný emitent „FALSE“ – referenčním subjektem není veřejnoprávní a veřejný emitent

▼M3

40	Referenční závazek	Vyplní se pro derivát na swap úvěrového selhání na jedno jméno, a to kódem ISIN referenčního závazku.	{ISIN}
41	Referenční subjekt	Vyplní se referenčním subjektem swapu úvěrového selhání na jedno jméno nebo derivátu na swap úvěrového selhání na jedno jméno.	{COUNTRYCODE_2} nebo ISO 3166-2 – kód země ze 2 znaků následovaný pomlčkou „-“ a kódem nižší územní jednotky až ze 3 alfanumerických znaků nebo {LEI}
42	Jmenovitá měna	Měna, v níž je denominována jmenovitá částka.	{CURRENCYCODE_3}

Deriváty povolenek na emise

Pole v tomto oddíle se vyplňují pouze pro deriváty povolenek na emise ve smyslu tabulky 13.1 oddílu 13 přílohy III

43	Podtyp derivátu povolenek na emise	Vyplní se, je-li proměnná #3 „identifikační kód MiFIR“ „DERV“ – derivát a proměnná #4 „kategorie aktiv podkladového nástroje“ je „EMAL“ – povolenky na emise.	„CERE“ – CER „ERUE“ – ERU „EUAE“ – EUA „EUAA“ – EUAA „OTHR“ – jiné

▼M3

PŘÍLOHA V

Kvantitativní údaje, které mají být poskytnuty pro účely výpočtů transparentnosti

Tabulka 1

Tabulka symbolů pro tabulku 2

Symbol	Druh údajů	Definice
{ALPHANUM-n}	Až n alfanumerických znaků	Volný text
{ISIN}	12 alfanumerických znaků	Kód ISIN ve smyslu normy ISO 6166
{MIC}	4 alfanumerické znaky	Identifikační kód trhu ve smyslu normy ISO 10383
{DATEFORMAT}	Formát data podle ISO 8601	Formátování dat: RRRR-MM-DD
{DECIMAL-n/m}	Celkem až n-místné desetinné číslo, z čehož až m míst může být zlomková část	Numerické pole pro kladné i záporné hodnoty. Desetinný oddělovač je „.“ (tečka), před zápornými čísly je znaménko „–“ (minus); hodnoty se zaokrouhlují a nezkracují.
{INTEGER-n}	Až n-místné celé číslo	Numerické pole pro kladné i záporné celé hodnoty.

Tabulka 2

Podrobnosti o údajích, které mají být poskytnuty pro účely určení likvidního trhu a prahových hodnot LIS (velký rozsah) a SSTI (konkrétní objem pro daný nástroj) pro nekapitálové finanční nástroje

Č.	Pole	Podrobnosti, které se mají vykazovat	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát a normy pro oznamování
1	Identifikační kód nástroje	Kód k identifikaci finančního nástroje	Regulovaný trh (RM) Mnohostranný obchodní systém (MTF) Organizovaný obchodní systém (OTF) Schválený systém pro uveřejňování informací (APA) Poskytovatel konsolidovaných obchodních informací (CTP)	{ISIN}
2	Datum provedení	Datum provedení obchodů.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DATEFORMAT}

▼M3

Č.	Pole	Podrobnosti, které se mají vykazovat	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát a normy pro oznamování
3	Místo provedení	MIC segmentu obchodního systému EU nebo systematického internalizátora, je-li k dispozici, v opačném případě operační MIC. MIC segmentu systematického internalizátora, existuje-li, jinak operační MIC. Kód MIC XOFF pro mimoburzovní obchody. Pro daný ISIN a datum provedení shrnou schválené systémy pro uveřejňování informací všechny mimoburzovní obchodní aktivity pro daný nástroj do jediného záznamu (ISIN, XOFF, datum provedení).	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{MIC} obchodního systému nebo systematického internalizátora nebo „XOFF“
4	Označení pozastaveného nástroje	Ukazatel toho, zda bylo obchodování s nástrojem v příslušném obchodním systému v den provedení pozastaveno po celý den. V důsledku toho se pole 5 vykazuje s nulovou hodnotou.	RM, MTF, OTF	„TRUE“ – pokud byl nástroj pozastaven na celý obchodní den nebo „FALSE“ – pokud nástroj nebyl pozastaven na celý obchodní den
5	Celkový počet obchodů	Celkový počet obchodů provedených v den provedení. Obchody, které byly zrušeny, musí být z hlášených údajů vyloučeny. Obchody, které využívají odklad uveřejnění, se započítávají do souhrnných údajů poskytnutých předkládajícími subjekty na základě data provedení. Ve všech případech musí být pole vyplněno hodnotou větší nebo rovnou nule. U nástrojů, které jsou pozastaveny na celý den, musí mít pole nulovou hodnotu.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
6	Celkový objem	Celkový objem provedený v den provedení. Objem se měří podle tabulky 4 přílohy II tohoto nařízení. Peněžní částky se uvádějí v eurech. Obchody, které byly zrušeny, musí být z hlášených údajů vyloučeny. Obchody, které využívají odklad uveřejnění, se započítávají do souhrnných údajů poskytnutých předkládajícími subjekty na základě data provedení.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

▼M3

Č.	Pole	Podrobnosti, které se mají vykazovat	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát a normy pro oznamování
7	Rozmezí pásma „objem obchodu“	Toto pole se vyplní hodnotami uvedenými v tabulkách 3 a 4 této přílohy. Rozmezí pásem objemu obchodů jsou definována: v tabulce 4 této přílohy pro povolenky na emise a jejich deriváty; v tabulce 3 této přílohy pro ostatní nástroje. U nástrojů, které jsou pozastaveny na celý den, se údaje týkající se tohoto pole a polí 8 a 9 neuvádějí.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{ALPHANUM -140}
8	Celkový počet obchodů provedených pro dané pásmo	Celkový počet obchodů provedených v den provedení, jejichž objem je v rozmezí pásma. Obchody, které byly zrušeny, musí být z hlášených údajů vyloučeny. Obchody, které využívají odklad uveřejnění, se započítávají do souhrnných údajů poskytnutých předkládajícími subjekty na základě data provedení.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
9	Celkový obchodovaný objem pro dané pásmo	Celkový obchodovaný objem představovaný všemi obchody provedenými v den vykazování, jejichž objem je v rozmezí pásma. Objem se měří podle tabulky 4 přílohy II tohoto nařízení. Peněžní částky se uvádějí v eurech. Obchody, které byly zrušeny, musí být z hlášených údajů vyloučeny. Obchody, které využívají odklad uveřejnění, se započítávají do souhrnných údajů poskytnutých předkládajícími subjekty na základě data provedení.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

▼M3

Tabulka 3

Pásma objemu obchodů pro dluhopisy, strukturované finanční produkty, sekuritizované deriváty, úrokové deriváty, akciové deriváty, měnové deriváty, úvěrové deriváty, komoditní deriváty, deriváty C10 a finanční rozdílové smlouvy

Rozsah	Pásmo objemu obchodu	Definice
Obchody o objemu mezi 0 a 1,000,000 (vyjma)	]0 – 100,000[	Obchody o objemu menším než 100,000 EUR
	[100,000 – 100,000]	Obchody o objemu rovném 100,000 EUR
	]100,000 – 200,000[	Obchody o objemu větším než 100,000 EUR a menším než 200,000 EUR
	[200,000 – 300,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 200,000 EUR a menším než 300,000 EUR
	[300,000 – 400,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 300,000 EUR a menším než 400,000 EUR
	[Y – Y + 100,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném Y EUR a menším než Y + 100,000 EUR (krok 100,000 EUR)
	[900,000 – 1,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 900,000 EUR a menším než 1,000,000 EUR
Obchody o objemu mezi 1,000,000 (včetně) a 10,000,000 (vyjma)	[1,000,000 – 1,500,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 1,000,000 EUR a menším než 1,500,000 EUR
	[1,500,000 – 2,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 1,500,000 EUR a menším než 2,000,000 EUR
	[Z – Z + 500,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném Z EUR a menším než Z + 500,000 EUR (krok 500,000 EUR)
	[9,500,000 – 10,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 9,500,000 EUR a menším než 10,000,000 EUR
Obchody o objemu mezi 10,000,000 (včetně) a 100,000,000 (vyjma)	[10,000,000 – 15,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 10,000,000 EUR a menším než 15,000,000 EUR
	[15,000,000 – 20,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 15,000,000 EUR a menším než 20,000,000 EUR
	[W – W + 5,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném W EUR a menším než W + 5,000,000 EUR (krok 5,000,000 EUR)
	[95,000,000 – 100,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 95,000,000 EUR a menším než 100,000,000 EUR
Obchody o objemu větším nebo rovném 100,000,000	[100,000,000 – 125,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 100,000,000 EUR a menším než 125,000,000 EUR
	[125,000,000 – 150,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 125,000,000 EUR a menším než 150,000,000 EUR
	[X – X + 25,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném X EUR a menším než X + 25,000,000 EUR (krok 25,000,000 EUR)
…	…	…

▼M3

Tabulka 4

Rozmezí pásem objemu obchodů pro povolenky na emise a deriváty na emisní povolenky

Rozsah	Pásmo objemu obchodu	Definice
Obchody o objemu mezi 0 a 1,000,000 (vyjma)	]0 – 100,000[	Obchody o objemu menším než 100,000 tun ekvivalentu oxidu uhličitého (tCO_2e)
	[100,000 – 100,000]	Obchody o objemu rovném 100,000 tCO_2e
	]100,000 – 200,000[	Obchody o objemu větším než 100,000 tCO_2e a menším než 200,000 tCO_2e
	[200,000 – 300,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 200,000 tCO_2e a menším než 300,000 tCO_2e
	[300,000 – 400,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 300,000 tCO_2e a menším než 400,000 tCO_2e
	[Y – Y + 100,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném Y tCO_2e a menším než Y tCO_2e + 100,000 (krok 100,000 tCO_2e)
	[900,000 – 1,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 900,000 tCO_2e a menším než 1,000,000 tCO_2e
Obchody o objemu mezi 1,000,000 (včetně) a 10,000,000 (vyjma)	[1,000,000 – 1,500,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 1,000,000 tCO_2e a menším než 1,500,000 tCO_2e
	[1,500,000 – 2,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 1,500,000 tCO_2e a menším než 2,000,000 tCO_2e
	[Z – Z + 500,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném Z tCO_2e a menším než Z tCO_2e + 500,000 (krok 500,000 tCO_2e)
	[9,500,000 – 10,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 9,500,000 tCO_2e a menším než 10,000,000 tCO_2e
Obchody o objemu mezi 10,000,000 (včetně) a 100,000,000 (vyjma)	[10,000,000 – 15,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 10,000,000 tCO_2e a menším než 15,000,000 tCO_2e
	[15,000,000 – 20,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 15,000,000 tCO_2e a menším než 20,000,000 tCO_2e
	[W – W + 5,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném W tCO_2e a menším než W tCO_2e + 5,000,000 (krok 5,000,000 tCO_2e)
	[95,000,000 – 100,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 95,000,000 tCO_2e a menším než 100,000,000 tCO_2e
Obchody o objemu větším nebo rovném 100,000,000	[100,000,000 – 125,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 100,000,000 tCO_2e a menším než 125,000,000 tCO_2e
	[125,000,000 – 150,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném 125,000,000 tCO_2e a menším než 150,000,000 tCO_2e
	[X – X + 25,000,000[	Obchody o objemu větším nebo rovném X tCO_2e a menším než X tCO_2e + 25,000,000 (krok 25,000,000 tCO_2e)
…	…	…