Käesolev tekst on üksnes dokumenteerimisvahend ning sel ei ole mingit õiguslikku mõju. Liidu institutsioonid ei vastuta selle teksti sisu eest. Asjakohaste õigusaktide autentsed versioonid, sealhulgas nende preambulid, on avaldatud Euroopa Liidu Teatajas ning on kättesaadavad EUR-Lexi veebisaidil. Need ametlikud tekstid on vahetult kättesaadavad käesolevasse dokumenti lisatud linkide kaudu

►B

KOMISJONI DELEGEERITUD MÄÄRUS (EL) 2017/583,

14. juuli 2016,

millega täiendatakse finantsinstrumentide turge käsitlevat Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad kauplemiskohtade ja investeerimisühingute suhtes kohaldatavaid läbipaistvuse nõudeid võlakirjade, struktureeritud finantstoodete, lubatud heitkoguste väärtpaberite ning tuletisinstrumentide puhul

(EMPs kohaldatav tekst)

(ELT L 87, 31.3.2017, lk 229)

Muudetud:

		Euroopa Liidu Teataja		
		nr	lehekülg	kuupäev
►M1	Komisjoni delegeeritud määrus (EL) 2021/529, 18. detsember 2020	L 106	47	26.3.2021
►M2	Komisjoni delegeeritud määrus (EL) 2022/629, 12. jaanuar 2022	L 115I	1	13.4.2022
►M3	Komisjoni delegeeritud määrus (EL) 2023/945, 17. jaanuar 2023	L 131	17	16.5.2023
►M4	Komisjoni delegeeritud määrus (EL) 2025/1246, 18. juuni 2025	L 1246	1	3.11.2025

Parandatud:

►C1 Parandus, ELT L 90102, 21.11.2023, lk 1 (2023/945)

▼B

KOMISJONI DELEGEERITUD MÄÄRUS (EL) 2017/583,

14. juuli 2016,

millega täiendatakse finantsinstrumentide turge käsitlevat Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad kauplemiskohtade ja investeerimisühingute suhtes kohaldatavaid läbipaistvuse nõudeid võlakirjade, struktureeritud finantstoodete, lubatud heitkoguste väärtpaberite ning tuletisinstrumentide puhul

(EMPs kohaldatav tekst)

I PEATÜKK

MÕISTED

▼M4

Artikkel 1

Mõisted

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 9 lõike 5 punkt f)

Käesolevas määruses kasutatakse järgmisi mõisteid:

1) „keskne piirangutega tellimusraamatupõhine kauplemissüsteem” on üks järgmistest:

   a) tellimusraamatupõhine kestevoksjoni kauplemissüsteem, mis inimsekkumiseta toimiva tellimusraamatu ja kauplemisalgoritmi abil sobitab pidevalt müügikorraldusi ostukorraldustega parima võimaliku hinna alusel;

   b) kauplemissüsteem, milles on ühendatud punktis a osutatud tellimusraamatupõhise kauplemissüsteemi ja punktis 2 määratletud perioodioksjonipõhise kauplemissüsteemi elemendid;

2) „perioodioksjonipõhine kauplemissüsteem” on inimeste sekkumiseta toimiv kauplemissüsteem, mis sobitab korraldusi perioodioksjoni ja kauplemisalgoritmi põhjal.

Artikkel 1a

Artiklite 3, 6, 8, 9, 10, 11 ja 13 kohaldamisala

1. Artikleid 3, 6, 9, 10, 11 ja 13 kohaldatakse ainult tuletisinstrumentide suhtes. Artiklit 8 kohaldatakse ainult tuletisinstrumentide ja kombineeritud tehingute suhtes.

2. Käesoleva määruse artiklites 8 ja 11 sisalduvaid viiteid määruse (EL) nr 600/2014 artiklile 11 käsitatakse viidetena määruse (EL) nr 600/2014 artiklile 11, nagu seda kohaldati enne 28. märtsi 2024.

▼B

II PEATÜKK

REGULEERITUD TURGUDE, MITMEPOOLSETE KAUPLEMISSÜSTEEMIDE JA ORGANISEERITUD KAUPLEMISSÜSTEEMIDE KAUPLEMISEELNE LÄBIPAISTVUS

Artikkel 2

Kauplemiseelse läbipaistvuse kohustused

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 8 lõiked 1 ja 2)

Kauplemiskohta korraldavad turukorraldajad ja investeerimisühingud peavad avalikustama ostu- ja müügipakkumiste hindade vahemiku ning kauplemisvalmiduse tõsiduse nende hindade juures vastavalt kauplemissüsteemi liigile, mida nad korraldavad, ja I lisas sätestatud teavitamisnõuetele.

Artikkel 3

Suuremahulised korraldused

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 9 lõike 1 punkt a)

Korraldus on võrreldes tavapärase turumahuga suuremahuline, kui see on sisestamise ajal või pärast muutmist võrdne korralduse miinimummahuga, mis määratakse kindlaks artiklis 13 sätestatud meetodiga, või sellest suurem.

▼M4

Artikkel 3a

Suuremahulised korraldused võlakirjade, struktureeritud finantstoodete ja lubatud heitkoguste väärtpaberite puhul

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 9 lõike 1 punkt a)

Võlakirju, struktureeritud finantstooteid või lubatud heitkoguste väärtpabereid hõlmav korraldus on võrreldes turu tavamahuga suuremahuline, kui see on sisestamise ajal või pärast muutmist võrdne järgmiste künnistega või neist suurem:

a) III lisa tabelis 2.3 sätestatud künnised kõigi võlakirjaliikide, välja arvatud börsil kaubeldavate kaupade ja börsil kaubeldavate võlakirjade puhul;

b) III lisa tabelis 2.5 sätestatud künnised börsil kaubeldavate kaupade ja börsil kaubeldavate võlakirjade puhul;

c) III lisa tabelis 3.2 sätestatud künnised struktureeritud finantstoodete puhul;

d) III lisa tabelis 12.2 sätestatud künnised lubatud heitkoguste väärtpaberite puhul.

▼B

Artikkel 4

Korralduste haldamise süsteemis hoitavate korralduste liik ja minimaalne maht

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 9 lõike 1 punkt a)

1. Kauplemiskoha korralduste haldamise süsteemis hoitava ja avalikustamist ootava korralduse liik, mille puhul võib vabastada kauplemiseelse läbipaistvuse kohustustest, on korraldus,

a) mis kavatsetakse avaldada kauplemiskoha peetavas tellimusraamatus ja mis sõltub süsteemi protokolliga eelnevalt kindlaks määratud objektiivsetest tingimustest;

b) millel ei ole enne kauplemiskoha peetavas tellimusraamatus avalikustamist vastastikmõju muu kauplemishuviga;

c) millel on saab pärast tellimusraamatus avalikustamist vastastikmõju muude korraldustega kooskõlas sellist liiki korralduste suhtes avalikustamise ajal kohaldatavate eeskirjadega.

2. Kauplemiskoha korralduste haldamise süsteemis hoitavate ja avalikustamist ootavate selliste korralduste miinimummaht, mis võidakse vabastada kauplemiseelse läbipaistvuse kohustustest, on sisestamise hetkel ning pärast mis tahes muudatuse tegemist:

a) reserveerimiskorralduse puhul 10 000 eurot või sellest suurem;

b) kõigi muude korralduste puhul võrdne süsteemi korraldaja eeskirjade ja protokollide kohaselt eelnevalt kehtestatud minimaalse kaubeldava kogusega või sellest suurem.

3. Lõike 2 punktis a osutatud reserveerimiskorraldust käsitatakse määratud hinnaga korraldusena, mis koosneb avalikustatud korraldusest, mis on seotud koguse teatava osaga, ja avalikustamata korraldusest, mis on seotud koguse ülejäänud osaga, kusjuures avalikustamata kogusega saab tehingu teha alles pärast selle avalikustamist tellimusraamatus uue avalikustatud korraldusena.

▼M3

4. Lõike 2 punkti a kohaldamisel mõõdetakse korralduste haldamise süsteemis hoitavate korralduste mahtu II lisa tabeli 2 lahtris 10 osutatud kaubeldavate lepingute tingliku väärtuse alusel.

▼M4

▼B

Artikkel 6

Selliste finantsinstrumentide klassid, millel ei ole likviidset turgu

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 9 lõike 1 punkt c)

Finantsinstrumenti või finantsinstrumentide klassi käsitatakse likviidset turgu mitteomavana, kui see on niiviisi määratletud kooskõlas artiklis 13 sätestatud meetoditega.

▼M4

Artikkel 6a

Selliste võlakirjade, struktureeritud finantstoodete ja lubatud heitkoguste väärtpaberite klassid, millel ei ole likviidset turgu

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 9 lõike 1 punkt c)

Selleks et teha kindlaks, kas võlakirja, struktureeritud finantstoodet või lubatud heitkoguste väärtpaberit tuleb käsitada likviidset turgu mitteomavana, kohaldavad pädevad asutused järgmist staatilist likviidsuse kindlaksmääramist:

a) III lisa tabelis 2.2 sätestatud kindlaksmääramine kõigi võlakirjaliikide, välja arvatud börsil kaubeldavate kaupade ja börsil kaubeldavate võlakirjade puhul;

b) III lisa tabelis 2.4 sätestatud kindlaksmääramine börsil kaubeldavate kaupade ja börsil kaubeldavate võlakirjade puhul;

c) III lisa tabelis 3.1 sätestatud kindlaksmääramine struktureeritud finantstoodete puhul;

d) III lisa tabelis 12.1 sätestatud kindlaksmääramine lubatud heitkoguste väärtpaberite puhul.

▼B

III PEATÜKK

KAUPLEMISKOHTADE JA VÄLJASPOOL KAUPLEMISKOHTA KAUPLEVATE INVESTEERIMISÜHINGUTE KAUPLEMISJÄRGNE LÄBIPAISTVUS

Artikkel 7

Kauplemisjärgse läbipaistvuse kohustused

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 10 lõige 1 ning artikli 21 lõiked 1 ja 5)

1. Väljaspool kauplemiskoha eeskirju kauplevad investeerimisühingud ning kauplemiskohta korraldavad turukorraldajad ja investeerimisühingud peavad avalikustama iga tehingu kohta II lisa tabelites 1 ja 2 sätestatud andmed ning kasutama igat II lisa tabelis 3 loetletud kohaldatavat märgist.

▼M4

II lisa tabelis 2 esitatud lahtrite nimed avalikustatakse kooskõlas kõnealuses tabelis esitatud lahtri tähiste vorminguga.

▼B

2. Kui varem avaldatud kauplemisaruanne tühistatakse, avaldavad väljaspool kauplemiskohta kauplevad investeerimisühingud ning kauplemiskohta korraldavad turukorraldajad ja investeerimisühingud uue kauplemisaruande, mis sisaldab kõiki algse kauplemisaruande üksikasju ja II lisa tabelis 3 täpsustatud tühistamismärgist.

3. Kui varem avaldatud kauplemisaruannet muudetakse, avaldavad väljaspool kauplemiskohta kauplevad investeerimisühingud ning kauplemiskohta korraldavad turukorraldajad ja investeerimisühingud järgmise teabe:

a) uus kauplemisaruanne, mis sisaldab kõiki algse kauplemisaruande üksikasju ja II lisa tabelis 3 täpsustatud tühistamismärgist;

b) uus kauplemisaruanne, mis sisaldab kõiki algse kauplemisaruande üksikasju kõigi vajalike parandustega ning II lisa tabelis 3 täpsustatud muutmismärgist.

▼M4

4. Kauplemisjärgne teave avalikustatakse reaalajale nii lähedasel ajal kui tehniliselt võimalik ning igal juhul viie minuti jooksul pärast asjaomase tehingu tegemist.

_____

▼B

7. Investeerimisühingud astuvad kõik mõistlikud sammud, et tagada tehingu avalikustamine ühe tehinguna. Seega tuleb kahte samal ajal sisestatud ja sama hinna ning ühe ja sama vastaspoolega tehtavat sobitatud tehingut käsitada ühe tehinguna.

▼M4

8. Kombineeritud tehinguga seotud teave hõlmab kombineeritud tehingu märgist või materiaalse vara vastu vahetuse märgist, nagu on täpsustatud II lisa tabelis 3. Kui kombineeritud tehingu puhul võib artikli 8 kohaselt avalikustamisega viivitada, tehakse kõikide komponentide kohta teave kättesaadavaks pärast seda, kui tehingu viivitusperiood on möödunud.

▼B

Artikkel 8

Tehingute avalikustamisega viivitamine

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 11 lõiked 1 ja 3 ning artikli 21 lõige 4)

1. Kui pädev asutus lubab määruse (EL) nr 600/2014 artikli 11 lõike 1 kohaselt tehingu andmete avalikustamisega viivitada, avalikustavad väljaspool kauplemiskohta kauplevad investeerimisühingud ning kauplemiskohta korraldavad turukorraldajad ja investeerimisühingud iga tehingu hiljemalt kell 19.00 kohaliku aja järgi teisel tööpäeval pärast tehingu kuupäeva, tingimusel, et on täidetud üks järgmistest tingimustest:

a) tehing on suuremahuline võrreldes tavapärase turumahuga, nagu on täpsustatud artiklis 9;

▼B

b) tehing tehakse finantsinstrumendi või finantsinstrumentide klassiga, millel ei ole likviidset turgu, nagu on täpsustatud kooskõlas artiklis 13 sätestatud meetoditega;

c) tehingu teevad investeerimisühing, mis kaupleb oma arvel muul viisil kui Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2014/65/EL ([1]) artikli 4 lõike 1 punkti 38 kohasel kliendikorralduste sobitamistehingu põhimõttel, ja muu vastaspool ning tehingu maht ületab instrumendile omast mahtu vastavalt artiklile 10;

d) tehing on kombineeritud tehing, mis vastab ühele järgmistest kriteeriumidest:

i) üks või mitu selle komponenti on tehingud finantsinstrumentidega, millel ei ole likviidset turgu;

ii) üks või mitu selle komponenti on tehingud finantsinstrumentidega, mis on vastavalt artiklile 9 tavapärase turumahuga võrreldes suuremahulised;

iii) tehingu teevad investeerimisühing, mis kaupleb oma arvel muul viisil kui direktiivi 2014/65/EL artikli 4 lõike 1 punkti 38 kohasel kliendikorralduste sobitamistehingu põhimõttel, ja muu vastaspool ning tehingu üks või mitu komponenti on tehingud finantsinstrumentidega, mille maht ületab instrumendile omast mahtu vastavalt artiklile 10.

2. Kui lõikes 1 sätestatud viivitusperiood on möödunud, tuleb tehingu kõik üksikasjad avalikustada, välja arvatud juhul, kui kooskõlas artikliga 11 on viivitusperioodi pikendatud või lubatud tähtajatu viivitamine.

3. Kui kahe investeerimisühingu vaheline tehing tehakse väljaspool kauplemiskoha eeskirju oma arvel või klientide nimel, on kohaldatava avalikustamisega viivitamise korra kindlaksmääramise eesmärgil pädev asutus selle investeerimisühingu pädev asutus, kes vastutab tehingu avalikustamise eest tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja kaudu artikli 7 lõigete 5, 6 ja 7 järgi.

▼M4

Artikkel 8a

Võlakirjade, struktureeritud finantstoodete ja lubatud heitkoguste väärtpaberitega tehtud tehingute avalikustamisega viivitamine

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikkel 11)

1. Kauplemiskohta korraldavad turukorraldajad ja investeerimisühingud ning väljaspool kauplemiskohta kauplevad investeerimisühingud võivad võlakirjadega (v.a börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad) tehtud tehingute üksikasjade avalikustamisega viivitada järgmiselt:

([1]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 15. mai 2014. aasta direktiiv 2014/65/EL finantsinstrumentide turgude kohta ning millega muudetakse direktiive 2002/92/EÜ ja 2011/61/EL (ELT L 173, 12.6.2014, lk 349).

▼M4

a) hinna ja mahu andmete avalikustamisega viivitamine kuni 15 minutit III lisa tabelis 2.6 osutatud kategooria 1 tehingute puhul;

b) hinna ja mahu andmete avalikustamisega viivitamine kuni kauplemispäeva lõpuni III lisa tabelis 2.6 osutatud kategooria 2 tehingute puhul;

c) hinna andmete avalikustamisega viivitamine kuni tehingu kuupäevale järgneva esimese kauplemispäeva lõpuni ja mahu andmete avalikustamisega viivitamine kuni üks nädal pärast tehingu kuupäeva III lisa tabelis 2.6 osutatud kategooria 3 tehingute puhul;

d) hinna andmete avalikustamisega viivitamine kuni tehingu kuupäevale järgneva teise kauplemispäeva lõpuni ja mahu andmete avalikustamisega viivitamine kuni kaks nädalat pärast tehingu kuupäeva III lisa tabelis 2.6 osutatud kategooria 4 tehingute puhul;

e) hinna ja mahu andmete avalikustamisega viivitamine kuni neli nädalat pärast tehingu kuupäeva III lisa tabelis 2.6 osutatud kategooria 5 tehingute puhul.

2. Kauplemiskohta korraldavad turukorraldajad ja investeerimisühingud ning väljaspool kauplemiskohta kauplevad investeerimisühingud võivad börsil kaubeldavate kaupade, börsil kaubeldavate võlakirjade ja struktureeritud finantstoodetega tehtud tehingute üksikasjade avalikustamisega viivitada järgmiselt:

a) hinna andmete avalikustamisega viivitamine kuni tehingu kuupäevale järgneva teise kauplemispäeva lõpuni mis tahes suurusega tehingute puhul ja

b) mahu andmete avalikustamisega viivitamine kuni kaks nädalat pärast tehingu kuupäeva mis tahes suurusega tehingute puhul.

3. Kauplemiskohta korraldavad turukorraldajad ja investeerimisühingud ning väljaspool kauplemiskohta kauplevad investeerimisühingud avalikustavad iga lubatud heitkoguste väärtpaberitega seotud tehingu hiljemalt kell 19.00 kohaliku aja järgi teisel tööpäeval pärast tehingu kuupäeva tingimusel, et tehing on III lisa tabelis 12.2 osutatud lubatud heitkoguste väärtpaberite kauplemisjärgsest mahust suurem.

▼B

Artikkel 9

Suuremahulised tehingud

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 11 lõike 1 punkt a)

Tehingut käsitatakse võrreldes tavapärase turumahuga suuremahulisena, kui see on võrdne sellise tehingu miinimummahuga, mis arvutatakse artiklis 13 sätestatud meetodi kohaselt, või sellest suurem.

▼B

Artikkel 10

Finantsinstrumendile omane maht

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 11 lõike 1 punkt c)

Tehingut käsitatakse finantsinstrumendile omast mahtu ületavana, kui see on võrdne tehingu miinimummahuga, mis arvutatakse artiklis 13 sätestatud meetodi kohaselt, või sellest suurem.

Artikkel 11

Läbipaistvusnõuded seoses avalikustamisega viivitamisega pädevate asutuste äranägemisel

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 11 lõige 3)

1. Kui pädevad asutused kasutavad oma õigusi seoses avalikustamisega viivitamise lubamisega määruse (EL) nr 600/2014 artikli 11 lõike 3 järgi, siis kehtib järgmine:

a) kui kohaldatakse määruse (EL) nr 600/2014 artikli 11 lõike 3 punkti a, nõuavad pädevad asutused järgmistest andmetest ühe avalikustamist kogu artikli 8 kohase viivitusperioodi jooksul:

   i) kõik tehingu üksikasjad, mis on esitatud II lisa tabelites 1 ja 2, välja arvatud mahtu käsitlevad andmed;

   ii) tehingute päevased kokkuvõtlikud andmed vähemalt viie tehingu puhul, mis on tehtud samal päeval, tuleb avalikustada järgmisel tööpäeval enne kella 9.00 kohaliku aja järgi;

b) kui kohaldatakse määruse (EL) nr 600/2014 artikli 11 lõike 3 punkti b, lubavad pädevad asutused üksiku tehingu mahtu mitte avalikustada neljanädalase pikendatud perioodi jooksul;

c) mittekapitaliinstrumentide puhul, mis ei ole riigi võlakohustused, ja juhul, kui kohaldatakse määruse (EL) nr 600/2014 artikli 11 lõike 3 punkti c, lubavad pädevad asutused neljanädalase pikendatud viivitusperioodi jooksul avalikustada ühe kalendrinädala jooksul tehtud mitme tehingu kokkuvõtlikud andmed järgmisel teisipäeval enne kella 9.00 kohaliku aja järgi.

▼M4

_____

▼B

2. Kui lõike 1 punktis b sätestatud pikendatud viivitusperiood on möödunud, siis kohaldatakse järgmisi nõudeid:

a) kõikide instrumentide puhul, mis ei ole riigi võlakohustused, avalikustatakse kõikide üksikute tehingute täielikud andmed järgmisel tööpäeval enne kella 9.00 kohaliku aja järgi.

▼M4

_____

▼B

3. Kõikide instrumentide puhul, mis ei ole riigi võlakohustused, avalikustatakse kõik üksikute tehingute üksikasjad neli nädalat pärast kokkuvõtlike andmete avalikustamist kooskõlas lõike 1 punktiga c enne kella 9.00 kohaliku aja järgi.

▼M4

4. Lõigetes 1 ja 2 osutatud kokkuvõtlikud päeva- või nädalaandmed sisaldavad tuletisinstrumentide puhul asjaomase kalendriperioodi iga päeva või nädala kohta järgmist teavet:

a) kaalutud keskmine hind;

b) kogu kauplemismaht, millele on viidatud II lisa tabelis 4;

c) tehingute koguarv.

▼B

5. Tehingud koondatakse ISIN-koodi järgi. Kui ISIN-kood ei ole kättesaadav, koondatakse tehingud selle finantsinstrumentide klassi tasandil, mille suhtes kehtib artiklis 13 sätestatud likviidsustest.

▼M4

6. Kui lõike 1 punktis c ning lõigetes 2 ja 3 sätestatud avalikustamise nädalapäev ei ole tööpäev, toimub avalikustamine järgmisel tööpäeval enne kella 9.00 kohaliku aja järgi.

Artikkel 11a

Riigi võlakohustuste suhtes kohaldatavad läbipaistvusnõuded seoses avalikustamisega viivitamisega pädevate asutuste äranägemisel

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 11 lõige 3)

1. Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 11 lõike 3 punktis b osutatud mitme tehingu üksikasjade avaldamine kokkuvõtlikul kujul hõlmab tehinguid, mis on tehtud ühe kalendrinädala jooksul ja mis tehakse järgmisel teisipäeval enne kella 9.00 kohaliku aja järgi.

2. Lõikes 1 osutatud kokkuvõtlikud nädalaandmed sisaldavad asjaomase kalendriperioodi iga nädala kohta järgmist teavet:

a) kaalutud keskmine hind;

b) kogu kauplemismaht, millele on viidatud II lisa tabelis 4;

c) tehingute koguarv.

3. Tehingud koondatakse ISIN-koodi järgi.

4. Kui lõikes 1 sätestatud avalikustamise nädalapäev ei ole tööpäev, toimub avalikustamine järgmisel tööpäeval enne kella 9.00 kohaliku aja järgi.

▼M3

Artikkel 12

Kauplemisjärgse läbipaistvuse nõuete kohaldamine teatavate väljaspool kauplemiskohta tehtavate tehingute suhtes

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 21 lõige 1)

Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 21 lõikes 1 sätestatud kohustusi ei kohaldata komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 ([1]) artikli 2 lõikes 5 loetletud tehingute suhtes.

▼B

IV PEATÜKK

KAUPLEMISEELSE JA -JÄRGSE LÄBIPAISTVUSE ÜHISSÄTTED

Artikkel 13

Läbipaistvusega seotud arvutuste metoodika

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 9 lõiked 1 ja 2, artikli 11 lõige 1 ning artikli 22 lõige 1)

1. Selliste finantsinstrumentide või finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, millel ei ole artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b kohaldamisel likviidset turgu, kohaldatakse varaklasside lõikes järgmist metoodikat.

a) Staatiline likviidsuse kindlaksmääramine järgmistel juhtudel:

i) väärtpaberistatud tuletisinstrumentide varaklass, nagu on määratletud III lisa tabelis 4.1;

ii) järgmised aktsiatel põhinevate tuletisinstrumentide varaklassi alamklassid: aktsiaindeksioptsioonid, aktsiaindeksifutuurid/-forvardid, aktsiaoptsioonid, aktsiafutuurid/-forvardid, aktsiadividendioptsioonid, aktsiadividendifutuurid/-forvardid, dividendiindeksioptsioonid, dividendiindeksifutuurid/-forvardid, volatiilsusindeksioptsioonid, volatiilsusindeksifutuurid/-forvardid, börsil kaubeldavate fondide optsioonid, börsil kaubeldavate fondide futuurid/forvardid ning muud aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid, mis on määratletud III lisa tabelis 6.1;

iii) välisvaluuta tuletisinstrumentide varaklass, nagu on määratletud III lisa tabelis 8.1;

▼M4

iv) muude intressimäära tuletisinstrumentide, muude kauba tuletisinstrumentide, muude krediidituletisinstrumentide, muude C10 tuletisinstrumentide, muude hinnavahelepingute ja muude lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide varaklasside alamklassid, millele on osutatud III lisa tabelites 5.1, 7.1, 9.1, 10.1, 11.1 ja 13.1.

([1]) Komisjoni 28. juuli 2016. aasta delegeeritud määrus (EL) 2017/590, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad pädevatele asutustele tehingutest teatamist (C/2016/4733; ELT L 87, 31.3.2017, lk 449).

▼B

b) Perioodiline hindamine, mis põhineb kvantitatiivsetel, ja kui see on asjakohane, kvalitatiivsetel likviidsuskriteeriumidel järgmistel juhtudel:

▼M4

_____

▼B

iii) intressimäära tuletisinstrumentide varaklass, välja arvatud muude intressimäära tuletisinstrumentide alamklass, nagu on määratletud III lisa tabelis 5.1;

iv) järgmised aktsiatel põhinevate tuletisinstrumentide varaklassi alamklassid: vahetustehingud ja portfellivahetustehingud, nagu on määratletud III lisa tabelis 6.1;

v) kauba tuletisinstrumentide varaklass, välja arvatud muude kauba tuletisinstrumentide alamklass, nagu on määratletud III lisa tabelis 7.1;

vi) järgmised krediidituletisinstrumentide varaklassi alamklassid: indeksipõhised krediidiriski vahetustehingud ja ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingud, nagu on määratletud III lisa tabelis 9.1;

vii) C10 tuletisinstrumentide alamklass, välja arvatud muude C10 tuletisinstrumentide alamklass, nagu on määratletud III lisa tabelis 10.1;

viii) järgmised hinnavahelepingute varaklassi alamklassid: valuuta hinnavahelepingud ja kauba hinnavahelepingud, nagu on määratletud III lisa tabelis 11.1;

▼M4

_____

▼B

x) lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide alamklass, välja arvatud muude lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide alamklass, nagu on määratletud III lisa tabelis 13.1.

c) Perioodiline hindamine, mis põhineb kvalitatiivsetel likviidsuskriteeriumidel järgmistel juhtudel:

i) järgmised krediidituletisinstrumentide varaklassi alamklassid: krediidiriski vahetustehingute indeksi optsioonid ja ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingute optsioonid, nagu on määratletud III lisa tabelis 9.1;

ii) järgmised hinnavahelepingute varaklassi alamklassid: kapitali hinnavahelepingud, võlakirjade hinnavahelepingud, aktsiafutuuride/-forvardite hinnavahelepingud ning aktsiaoptsioonide hinnavahelepingud, nagu on määratletud III lisa tabelis 11.1.

▼M4

_____

▼B

2. ►M4 Artiklis 3 osutatud tavapärase turumahuga võrreldes suuremahuliste korralduste kindlaksmääramiseks kasutatakse järgmisi meetodeid. ◄

a) Künnisväärtus järgmistel juhtudel:

▼M4

_____

▼B

ii) väärtpaberistatud tuletisinstrumentide varaklass, nagu on määratletud III lisa tabelis 4.2;

iii) aktsiatel põhinevate tuletisinstrumentide iga alamklass, nagu on määratletud III lisa tabelites 6.2 ja 6.3;

iv) välisvaluuta tuletisinstrumentide iga alamklass, nagu on määratletud III lisa tabelis 8.2;

v) iga alamklass, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana, intressimäära tuletisinstrumentide, kauba tuletisinstrumentide, krediidituletisinstrumentide, C10 tuletisinstrumentide ning hinnavahelepingute varaklasside puhul, nagu on määratletud III lisa tabelites 5.3, 7.3, 9.3, 10.3 ja 11.3;

▼M4

vi) iga varade alamklass, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana, lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide varaklasside puhul, nagu on osutatud III lisa tabelis 13.3.

_____

▼B

b) ►M4 tehingusuuruse tase, millest allapoole jääb selliste tehingute protsent, mis vastavad tehingute protsentiilile, või künnise alamväärtus, olenevalt sellest, kumb on suurem, järgmistel juhtudel: ◄

▼M4

_____

▼B

ii) iga alamklass, millel on likviidne turg, intressimäära tuletisinstrumentide, kauba tuletisinstrumentide, krediidituletisinstrumentide, C10 tuletisinstrumentide ning hinnavahelepingute puhul, nagu on määratletud III lisa tabelites 5.2, 7.2, 9.2, 10.2 ja 11.2;

▼M4

iii) iga varade alamklass, millel on likviidne turg, lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide varaklasside puhul, nagu on osutatud III lisa tabelis 13.2;

_____

▼B

3. Artikli 8 lõike 1 punktis c osutatud finantsinstrumendile omase mahu ning artikli 8 lõike 1 punktis a osutatud tavapärase turumahuga võrreldes suuremahuliste tehingute kindlaksmääramiseks kasutatakse järgmisi meetodeid.

a) Künnisväärtus järgmistel juhtudel:

▼M4

_____

▼B

ii) väärtpaberistatud tuletisinstrumentide varaklass, nagu on määratletud III lisa tabelis 4.2;

iii) aktsiatel põhinevate tuletisinstrumentide iga alamklass, nagu on määratletud III lisa tabelites 6.2 ja 6.3;

iv) välisvaluuta tuletisinstrumentide iga alamklass, nagu on määratletud III lisa tabelis 8.2;

v) iga alamklass, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana, intressimäära tuletisinstrumentide, kauba tuletisinstrumentide, krediidituletisinstrumentide, C10 tuletisinstrumentide ning hinnavahelepingute varaklasside puhul, nagu on määratletud III lisa tabelites 5.3, 7.3, 9.3, 10.3 ja 11.3;

▼M4

vi) iga varade alamklass, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana, lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide varaklassi puhul, nagu on osutatud III lisa tabelis 13.3;

_____

_____

▼B

c) tehingusuuruse tase, millest allapoole jääb selliste tehingute protsent, mis vastavad tehingute protsentiilile, tehingusuuruse tase, millest allapoole jääb sellise mahu protsent, mis vastab mahu protsentiilile, või künnise alamväärtus iga alamklassi puhul, mida käsitatakse likviidset turgu omavana, olenevalt sellest, milline on suurim, intressimäära tuletisinstrumentide, kauba tuletisinstrumentide, krediidituletisinstrumentide, C10 tuletisinstrumentide ning hinnavahelepingute puhul, nagu on sätestatud III lisa tabelites 5.2, 7.2, 9.2, 10.2 ja 11.2;

▼M4

d) lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide puhul tehingusuuruse tase, millest allapoole jääb selliste tehingute protsent, mis vastavad tehingute protsentiilile, või künnise alamväärtus, olenevalt sellest, kumb on suurem, iga varade alamklassi puhul, mida käsitatakse likviidset turgu omavana, nagu on sätestatud III lisa tabelis 13.2.

▼B

4. Kui tavapärase turumahuga võrreldes suuremahulise tehingu kindlaksmääramise puhul mahu protsentiilile vastav tehingusuurus on suurem kui tehingute protsentiil 97,5, ei võeta lõike 3 punkti c kohaldamisel kauplemismahtu arvesse ning artikli 8 lõike 1 punktis c osutatud finantsinstrumendile omane maht ning artikli 8 lõike 1 punktis a osutatud tavapärase turumahuga võrreldes suuremahuliste tehingute maht määratakse kindlaks kui tehingusuuruse tase, millest allapoole jääb selliste tehingute protsent, mis vastavad tehingute protsentiilile, või künnise alamväärtus, olenevalt sellest, kumb on suurem.

▼B

5. Kooskõlas delegeeritud määrustega (EL) 2017/590 ja (EL) 2017/577 koguvad pädevad asutused iga päev kauplemiskohtadelt, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustajatelt ning kauplemiskoondteabe pakkujatelt andmeid, mis on vajalikud arvutuste tegemiseks, et määrata kindlaks:

a) finantsinstrumendid ja finantsinstrumentide klassid, millel ei ole likviidset turgu, nagu on sätestatud lõikes 1;

▼M4

b) suured mahud võrreldes tavapärase turumahuga ning instrumendile omane maht, nagu on sätestatud lõikes 3.

▼M3

Esimeses lõigus osutatud andmeid kogutakse kooskõlas V lisaga.

▼B

6. Finantsinstrumentide klassi puhul arvutusi tegevad pädevad asutused sõlmivad omavahel koostöökokkulepped, et tagada arvutusteks vajalike andmete koondamine kogu liidus.

▼M4

7. Lõike 1 punkti b, lõike 2 punkti b ning lõike 3 punktide c ja d kohaldamisel võtavad pädevad asutused arvesse liidus eelneva aasta 1. jaanuarist kuni 31. detsembrini tehtud tehinguid.

8. Lõike 2 punkti b ning lõike 3 punktide c ja d kohaldamisel määratakse tehingusuurus kindlaks selle mahunäitaja põhjal, mis on esitatud II lisa tabelis 4. Kui lõigete 2 ja 3 kohaldamiseks kindlaksmääratud tehingusuurust väljendatakse rahalise väärtusena ning finantsinstrument ei ole nomineeritud eurodes, arvestatakse tehingusuurus ümber valuutasse, milles see finantsinstrument on nomineeritud, kasutades Euroopa Keskpanga euro vahetuskurssi eelneva aasta 31. detsembri seisuga.

▼B

9. Kauplemiskohta korraldavad turukorraldajad ning investeerimisühingud võivad lõigete 2 ja 3 kohaselt kindlaksmääratud tehingusuurused arvestada ümber vastavasse arvu partiidesse, nagu asjaomane kauplemiskoht on asjaomase alamklassi või varaklassi alamklassi puhul eelnevalt kindlaks määranud. Kauplemiskohta korraldavad turukorraldajad ja investeerimisühingud võivad säilitada sellised tehingusuurused kuni kooskõlas lõikega 17 tehtud järgmiste arvutuste tulemuste kohaldamiseni.

▼M4

_____

11. Lõigetes 2 ja 3 osutatud näitajate kindlaksmääramisel ei kohaldata lõike 2 punkti b ning lõike 3 punkte c ja d, kui arvutamisel arvesse võetavate tehingute arv on alla 1 000. Sel juhul kohaldatakse selle asemel lõike 2 punktis a ja lõike 3 punktis a sätestatud künnisväärtusi.

▼B

12. ►M4 Välja arvatud juhul, kui need viitavad lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentidele, ümardatakse lõike 2 punktis b ning lõike 3 punktis c osutatud arvutused ülespoole järgmise ◄

a) 100 000ni, kui künnisväärtus on väiksem kui 1 miljon;

b) 500 000ni, kui künnisväärtus on 1 miljon või suurem, aga väiksem kui 10 miljonit;

c) 5 miljonini, kui künnisväärtus on 10 miljonit või suurem, aga väiksem kui 100 miljonit;

d) 25 miljonini, kui künnisväärtus on 100 miljonit või suurem.

13. Lõike 1 kohaldamisel määratakse iga varaklassi puhul III lisas täpsustatud kvantitatiivsed likviidsuskriteeriumid kindlaks III lisa 1. jao kohaselt.

▼M4

14. Aktsiatel põhinevate tuletisinstrumentide puhul, mis võeti kauplemiskohas kauplemisele või millega kaubeldi kauplemiskohas esimest korda ning mis ei kuulu alamklassi, mille puhul artikli 8 lõike 1 punktis c osutatud finantsinstrumendile omane maht ning artiklis 3 ja artikli 8 lõike 1 punktis a osutatud tavapärase turumahuga võrreldes suuremahuliste korralduste ja tehingute maht on avalikustatud ning mis kuuluvad ühte lõike 1 punkti a alapunktis ii kindlaksmääratud vara alamklassi, on finantsinstrumendile omane maht ning korralduste ja tavapärase turumahuga võrreldes suuremahuliste tehingute maht see, mida kohaldatakse sellise varade alamklassi väikseima päevase tingliku väärtuse vahemiku suhtes, kuhu aktsiatel põhinev tuletisinstrument kuulub.

15. Finantsinstrumente, mis võeti kauplemiskohas kauplemisele või millega kaubeldi kauplemiskohas esimest korda ning mis ei kuulu ühtegi alamklassi, mille puhul artikli 8 lõike 1 punktis c osutatud finantsinstrumendile omane maht ning artiklis 3 ja artikli 8 lõike 1 punktis a osutatud tavapärase turumahuga võrreldes suuremahuliste korralduste ja tehingute maht on avalikustatud, käsitatakse likviidset turgu mitteomavana kuni kooskõlas lõikega 17 tehtud arvutuste tulemuste kohaldamiseni. Artikli 8 lõike 1 punktis c osutatud finantsinstrumendile omane kohaldatav maht ning artiklis 3 ja artikli 8 lõike 1 punktis a osutatud tavapärase turumahuga võrreldes suuremahuliste korralduste ja tehingute maht on selliste alamklasside maht, mille puhul on tehtud kindlaks, et neil ei ole samale varade alamklassile kuuluvat likviidset turgu.

▼B

16. Kui finantsinstrument võeti kauplemiskohas kauplemisele või sellega kaubeldi kauplemiskohas esimest korda või kui varem esitatud üksikasjad on muutunud, esitavad kauplemiskohad pärast kauplemispäeva lõppu, aga enne selle päeva lõppu, pädevatele asutustele lõikes 5 osutatud arvutuste tegemiseks IV lisas sätestatud üksikasjaliku teabe.

▼M3

17. Pädevad asutused tagavad iga finantsinstrumendi ja finantsinstrumentide klassi puhul lõikes 5 osutatud arvutuste tulemuste avalikustamise määruse (EL) nr 600/2014 kohaldamise kuupäevale järgneva aasta 30. aprilliks ning seejärel iga aasta 30. aprilliks. Arvutuste tulemusi kohaldatakse alates avaldamisele järgneva iga aasta juuni esimesest esmaspäevast kuni järgmise aasta juuni esimesele esmaspäevale eelneva päevani.

▼M4

_____

▼B

Artikkel 14

Tehingud, mille suhtes kohaldatakse määruse (EL) nr 600/2014 artikli 1 lõikes 6 sätestatud erandit

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 1 lõige 6)

Tehingut käsitatakse EKPSi liikme poolt rahapoliitika, välisvaluutapoliitika ja finantsstabiilsuspoliitika rakendamisel sõlmituna, kui see tehing vastab mõnele järgmistest nõuetest:

a) tehing tehakse rahapoliitika eesmärgil, k.a Euroopa Liidu lepingule lisatud EKPSi ja Euroopa Keskpanga põhikirja artiklite 18 ja 20 kohaselt tehtud operatsioon või eurot mittekasutavates liikmesriikides asuvate EKPSi liikmete puhul samaväärsete riigisiseste sätete alusel tehtud operatsioon;

b) tehing on välisvaluutaoperatsioon, k.a liikmesriikide ametlike välisvaluutareservide hoidmiseks või haldamiseks tehtud operatsioonid või reservi haldamise teenus, mida osutab EKPSi liige teiste riikide keskpankadele, millele on võimaldatud erandit kooskõlas määruse (EL) nr 600/2014 artikli 1 lõikega 9;

c) tehing tehakse finantsstabiilsuspoliitika eesmärgil.

Artikkel 15

Tehingud, mille suhtes määruse (EL) nr 600/2014 artikli 1 lõikes 6 sätestatud erandit ei kohaldata

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 1 lõige 7)

Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 1 lõiget 6 ei kohaldata järgmist liiki tehingute suhtes, mille on sõlminud EKPSi liige sellise investeerimistehingu tegemiseks, mis ei ole seotud ühe artiklis 14 osutatud ülesande täitmisega selle liikme poolt:

a) tehingud, mis sõlmitakse oma vahendite haldamiseks;

▼B

b) haldusotstarbel või EKPSi liikme personali jaoks sõlmitud tehingud, sealhulgas oma personali pensioniskeemi haldurina tegutsedes tehtud tehingud;

c) oma investeerimisportfelli jaoks sõlmitud tehingud vastavalt riigisisesest õigusest tulenevatele kohustustele.

▼M4

Artikkel 16

Läbipaistvuskohustuste ajutine peatamine

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 9 lõige 4)

1. Finantsinstrumentide puhul, millel on võlakirjade, struktureeritud finantstoodete ja lubatud heitkoguste väärtpaberite puhul artiklis 6a ja tuletisinstrumentide puhul artiklis 13 sätestatud metoodika kohaselt kindlaks määratud likviidne turg, võivad pädevad asutused ajutiselt peatada määruse (EL) nr 600/2014 artiklites 8, 8a ja 10 sätestatud kohustused, kui võlakirjade, struktureeritud finantstoodete, lubatud heitkoguste väärtpaberite või tuletisinstrumentide klassi puhul moodustab II lisa tabelis 4 osutatud kogumaht, mis on arvutatud eelmise 30 kalendripäeva kohta, vähem kui 40 % keskmisest kuisest mahust, mis on arvutatud nendele 30 kalendripäevale eelneva 12 täiskalendrikuu kohta.

2. Finantsinstrumentide puhul, millel ei ole võlakirjade, struktureeritud finantstoodete ja lubatud heitkoguste väärtpaberite puhul artiklis 6a ja tuletisinstrumentide puhul artiklis 13 sätestatud metoodika kohaselt kindlaks määratud likviidset turgu, võivad pädevad asutused ajutiselt peatada määruse (EL) nr 600/2014 artiklites 8, 8a ja 10 osutatud kohustused, kui võlakirjade, struktureeritud finantstoodete, lubatud heitkoguste väärtpaberite või tuletisinstrumentide klassi puhul moodustab II lisa tabelis 4 osutatud kogumaht, mis on arvutatud eelmise 30 kalendripäeva kohta, vähem kui 20 % keskmisest kuisest mahust, mis on arvutatud nendele 30 kalendripäevale eelneva 12 täiskalendrikuu kohta.

3. Pädevad asutused võtavad lõigetes 1 ja 2 osutatud arvutusi tehes võlakirjade, struktureeritud finantstoodete, lubatud heitkoguste väärtpaberite või tuletisinstrumentide klassi puhul arvesse liidus kõikides kauplemiskohtades tehtud tehinguid. Pädevad asutused teevad need arvutused selle finantsinstrumentide klassi tasandil, mille suhtes kohaldatakse võlakirjade, struktureeritud finantstoodete ja lubatud heitkoguste väärtpaberite puhul artiklis 6a ning tuletisinstrumentide puhul artiklis 13 sätestatud likviidsustesti.

4. Enne kui pädevad asutused läbipaistvuskohustused peatavad, veenduvad nad, et likviidsuse märkimisväärne vähenemine kõikides kauplemiskohtades ei tulene finantsinstrumentide asjaomase klassi hooajalistest mõjudest likviidsusele.

▼B

Artikkel 19

Jõustumine ja kohaldamine

Käesolev määrus jõustub kahekümnendal päeval pärast selle avaldamist *Euroopa Liidu Teatajas*.

Seda kohaldatakse alates 3. jaanuarist 2018. Artiklit 18 kohaldatakse siiski alates käesoleva määruse jõustumise kuupäevast.

Käesolev määrus on tervikuna siduv ja vahetult kohaldatav kõikides liikmesriikides.

▼**M4**

I LISA

Süsteemide liigid ja artikli 2 kohaselt avalikustatav seonduv teave

Süsteemi liik	Avalikustatav teave
Tellimusraamatupõhine kestevoksjoni kauplemissüsteem	Iga finantsinstrumendi puhul korralduste koguarv ja neile vastav maht igal hinnatasemel, vähemalt viie parima ostu- ja müügipakkumiste hinna tasemel.
Perioodioksjonipõhine kauplemissüsteem	Iga finantsinstrumendi puhul hind, millega oksjonipõhine kauplemissüsteem vastab kõige paremini kauplemisalgoritmile, ja maht, mille ulatuses selles süsteemis osalejad võiksid selle hinna korral potentsiaalselt tehinguid teha.

▼B

II LISA

Avalikustatavad tehingute andmed

Tabel 1

Tabelis 2 kasutatavad tähised

TÄHIS	ANDMETE LIIK	MÄÄRATLUS
{ALPHANUM-n}	Kuni n tähtnumbrilist märki	Vabateksti lahter
{CURRENCYCODE_3}	3 tähtnumbrilist märki	kolmetäheline valuutakood (ISO 4217 valuutakood)
{DATE_TIME_FORMAT}	ISO 8601 vormingus kuupäev ja kellaaeg	Kuupäev ja kellaaeg järgnevas vormingus: AAAA-KK-PPTtt:mm:ss.dddddd**Z**, kus: — „AAAA” tähistab aastat; — „KK” tähistab kuud; — „PP” tähistab päeva; — „T” tähendab, et kellaaja ette tuleb kirjutada täht „T”; — „tt” tähistab tunde; — „mm” tähistab minuteid; — „ss.dddddd” tähistab sekundit ja selle murdosi; — „Z” tähistab UTC kellaaega. Kuupäevad ja kellaajad esitatakse UTC (koordineeritud maailmaaeg) kohaselt.
{DECIMAL-n/m}	Kuni n kümnendkohta, millest m kohta võivad olla murdarvud	Lahtrisse kantakse kas positiivne või negatiivne arv: — kümnendkohtade eraldusmärk on punkt (.); — negatiivsete arvude ees on miinus (–). Vajaduse korral väärtused ümardatakse, neid ei kärbita.
{ISIN}	12 tähtnumbrilist märki	ISIN kood, nagu on määratletud standardis ISO 6166
{MIC}	4 tähtnumbrilist märki	Turu tunnuskood, nagu on määratletud standardis ISO 10383.

▼M4

Tabel 2

Kauplemisjärgse läbipaistvuse eesmärgil esitatavate andmete loetelu

Avaldatud lahtrite nimed (veergude päised) peavad olema identsed tabelis 2 esitatud lahtri tähisega

Nr	Lahtri tähis	Finantsinstrumendid	Kirjeldus ja avaldatavad andmed	Täitmis- või avaldamiskoha liik	Kasutatav vorming, nagu on täpsustatud tabelis 1
1	Kauplemise kuupäev ja kellaaeg	Kõikide finantsinstrumentide puhul	Tehingu tegemise kuupäev ja kellaaeg. Kauplemiskohas tehtud tehingute puhul on detailsuse tase kooskõlas komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2025/1155 ([1]) artiklis 12 sätestatud nõuetega. Tehingute puhul, mida ei tehtud kauplemiskohas, on kuupäev ja kellaaeg see kuupäev ja kellaaeg, millal pooled lepivad kokku järgmiste lahtrite sisus: kogus, hind, valuutad (nagu on täpsustatud delegeeritud määruse (EL) 2017/590 I lisa tabeli 2 väljadel 31, 34 ja 44), instrumendi tunnuskood, instrumendi liigitus ja alusinstrumendi kood, kui see on asjakohane. Tehingute puhul, mida ei tehtud kauplemiskohas, esitatakse kellaaeg vähemalt lähima sekundi täpsusega. Kui tehing tuleneb korraldusest, mille täitev ühing on edastanud kliendi nimel kolmandale isikule, kui delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud edastamise tingimused ei olnud täidetud, on see tehingu kuupäev ja kellaaeg, mitte korralduse edastamise aeg.	Reguleeritud turg (RM) Mitmepoolne kauplemissüsteem (MTF) Organiseeritud kauplemissüsteem (OTF) Tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja (APA)	{DATE_TIME_FORMAT}
2	Instrumendi tunnuskood	Kõikide finantsinstrumentide puhul	Finantsinstrumendi tuvastamiseks kasutatav kood	RM, MTF, OTF, APA	{ISIN}

▼M4

Nr	Lahtri tähis	Finantsinstrumendid	Kirjeldus ja avaldatavad andmed	Täitmis- või avaldamiskoha liik	Kasutatav vorming, nagu on täpsustatud tabelis 1
3	Hind	Kõikide finantsinstrumentide puhul	Hind, millega tehing tehti, välja arvatud (kui see on asjakohane) vahendustasu ja kogunenud intressid. Hind, millega tehing tehti, esitatakse tavalise turustandardi kohaselt. Selles lahtris esitatav väärtus peab olema kooskõlas lahtris „Hinnanoteering” esitatud väärtusega. Kui andmed hinna kohta puuduvad, ent ollakse nende ootel (PNDG), või kui hinda ei kohaldata (NOAP), siis seda lahtrit ei täideta.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/13} juhul, kui hind on väljendatud rahalises väärtuses {DECIMAL-11/10} juhul, kui hind on väljendatud protsentides või tootlusena {DECIMAL-18/17} juhul, kui hind on väljendatud baaspunktides
4	Puuduv hind	Kõikide finantsinstrumentide puhul	Kui andmed hinna kohta puuduvad, ent ollakse nende ootel, on väärtus „PNDG”. Kui hind ei ole kohaldatav, on väärtus „NOAP”.	RM, MTF, OTF, APA	„PNDG” juhul, kui hind ei ole kättesaadav „NOAP” juhul, kui hinda ei kohaldata
5	Hinna valuuta	Kõikide finantsinstrumentide puhul	Peamine valuuta, milles hind on väljendatud (asjakohane juhul, kui hind on väljendatud rahalises väärtuses).	RM, MTF, OTF, APA	{CURRENCY CODE_3}
6	Hinnanoteering	Kõikide finantsinstrumentide puhul	Märge, kas hinda väljendatakse rahalise väärtusena, protsentides, baaspunktides või tootlusena. Hinnanoteering esitatakse tavalise turustandardi kohaselt. Krediidiriski vahetustehingute puhul märgitakse lahtrisse BAPO. Võlakirjade (v.a börsil kaubeldavad võlakirjad ja börsil kaubeldavad kaubad) puhul märgitakse siia lahtrisse tingliku väärtuse protsent (PERC). Kui protsentides väljendatud hind ei ole tavaline turustandard, märgitakse siia lahtrisse tavalise turustandardi kohaselt YIEL, BAPO või MONE. Selles lahtris esitatav väärtus peab olema kooskõlas lahtris „Hind” esitatud väärtusega. Kui hind on väljendatud rahalises väärtuses, esitatakse see peamise valuuta ühikus.	RM, MTF, OTF, APA	„MONE” – rahalises väärtuses „PERC” – protsentides „YIEL” – tootlusena „BAPO” – baaspunktides

▼M4

Nr	Lahtri tähis	Finantsinstrumendid	Kirjeldus ja avaldatavad andmed	Täitmis- või avaldamiskoha liik	Kasutatav vorming, nagu on täpsustatud tabelis 1
			Kui andmed hinna kohta puuduvad, ent ollakse nende ootel (PNDG), või kui hinda ei kohaldata (NOAP), siis seda lahtrit ei täideta.		
7	Kogus	Kõikide finantsinstrumentide puhul, välja arvatud käesoleva määruse artikli 11 lõike 1 punktides a ja b kirjeldatud juhtudel.	Ühikutena kaubeldavate finantsinstrumentide puhul finantsinstrumendi ühikute arv. Muul juhul tühi.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL- 18/17}
8	Kogus mõõtühikutes	Kauba tuletisinstrumentide, C10 tuletisinstrumentide, lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide ning lubatud heitkoguste väärtpaberite ühikutes kindlaksmääratud lepingute puhul, välja arvatud käesoleva määruse artikli 11 lõike 1 punktides a ja b kirjeldatud juhtudel.	Selle kauba või lubatud heitkoguste väärtpaberi, millega kaubeldakse, samaväärne summa mõõtühikutes.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL- 18/17}
9	Koguse märkimine mõõtühikutes	Kauba tuletisinstrumentide, C10 tuletisinstrumentide, lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide ning lubatud heitkoguste väärtpaberite ühikutes kindlaksmääratud lepingute puhul, välja arvatud käesoleva määruse artikli 11 lõike 1 punktides a ja b kirjeldatud juhtudel	Mõõtühikud, milles kogust väljendatakse.	RM, MTF, OTF, APA	„TOCD” – CO_2 ekvivalenttonnid lubatud heitkoguste väärtpaberitega seotud lepingu puhul „TONE” – tonnid „MWHO” – megavatt-tunnid „MBTU” – üks miljon Briti soojusühikut „THMS” – thermid „DAYS” – päevad ning {ALPHANUM-4} muul juhul

▼M4

Nr	Lahtri tähis	Finantsinstrumendid	Kirjeldus ja avaldatavad andmed	Täitmis- või avaldamiskoha liik	Kasutatav vorming, nagu on täpsustatud tabelis 1
10	Tinglik väärtus	Kõikide finantsinstrumentide puhul, välja arvatud käesoleva määruse artikli 11 lõike 1 punktides a ja b kirjeldatud juhtudel.	Sellesse lahtrisse märgitakse: i) võlakirjade (välja arvatud börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad) puhul nimiväärtus, mis on lunastamisel investorile tagasi makstav summa; ii) börsil kaubeldavate kaupade ja börsil kaubeldavate võlakirjade ning väärtpaberistatud tuletisinstrumentide puhul ostjate ja müüjate vahel vahetatud instrumentide arvu ja selle konkreetse tehingu puhul vahetatud instrumendi hinna korrutis. Teisisõnu lahtrite „Hind” ja „Kogus” korrutis; iii) struktureeritud finantstoodete puhul nimiväärtus ühiku kohta korrutatuna instrumentide arvuga tehingu ajal; iv) krediidiriski vahetustehingute puhul tinglik väärtus, mille puhul on kaitse omandatud või võõrandatud; v) optsioonide, vahetusoptsioonide, muude kui alapunktis iv osutatud vahetustehingute, futuuride ja forvardite puhul lepingu tinglik väärtus; vi) lubatud heitkoguste väärtpaberite puhul summa koguse eest lepingus sätestatud hinna korral tehingu ajal. Teisisõnu lahtrite „Hind” ja „Kogus mõõtühikutes” korrutis; vii) hinnavahekihlvedude puhul rahaline väärtus alusvaraks oleva finantsinstrumendi punkti muutuse kohta tehingu ajal;	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/5}

▼M4

Nr	Lahtri tähis	Finantsinstrumendid	Kirjeldus ja avaldatavad andmed	Täitmis- või avaldamiskoha liik	Kasutatav vorming, nagu on täpsustatud tabelis 1
			viii) hinnavahelepingute puhul ostjate ja müüjate vahel vahetatud instrumentide arvu ja selle konkreetse tehingu puhul vahetatud instrumendi hinna korrutis. Teisisõnu lahtrite „Hind” ja „Kogus” korrutis.		
11	Tinglik valuuta	Kõikide finantsinstrumentide puhul, välja arvatud käesoleva määruse artikli 11 lõike 1 punktides a ja b kirjeldatud juhtudel.	Peamine valuuta, milles tinglik väärtus on nomineeritud. Välisvaluutas tuletislepingu, mitmes valuutas vahetustehingu, sellise vahetusoptsiooni, mille alusvara on mitmes valuutas vahetustehing, valuuta hinnavahelepingu või hinnavahekihlveo lepingu puhul esimese poole tinglik valuuta.	RM, MTF, OTF, APA	{CURRENCY CODE_3}
12	[välja jäetud]				
13	Täitmiskoht	Kõikide finantsinstrumentide puhul	Selle täitmiskoha tunnuskood, kus tehing tehti. ELi kauplemiskohas tehtud tehingute puhul kasutage ISO 10383 segmendi MICi. Kui segmendi MIC puudub, kasutage korraldaja MICi. Finantsinstrumentide puhul, mis lubati kauplemisele või millega kaubeldakse kauplemiskohas, ja kui selle finantsinstrumendiga tehti tehing kliendi korralduste süsteemse täitja kaudu, kasutage koodi „SINT”. Finantsinstrumentide puhul, mis lubati kauplemisele või millega kaubeldakse kauplemiskohas, ja kui selle finantsinstrumendiga ei tehtud tehingut ELi kauplemiskohas ega kliendi korralduste süsteemse täitja kaudu, kasutage MIC-koodi „XOFF”. Kui tehing tehakse ELi-välisel organiseeritud kauplemisplatvormil, tuleb lisaks koodile „XOFF” täita ka lahter „Kolmanda riigi kauplemiskoht, kus tehing tehti”.	RM, MTF, OTF, APA	{MIC} – ELi kauplemiskohad või „SINT” – kliendi korralduste süsteemne täitja „XOFF” – muul juhul

▼M4

Nr	Lahtri tähis	Finantsinstrumendid	Kirjeldus ja avaldatavad andmed	Täitmis- või avaldamiskoha liik	Kasutatav vorming, nagu on täpsustatud tabelis 1
14	Kolmanda riigi kauplemiskoht, kus tehing tehti	Kõikide finantsinstrumentide puhul	Kolmanda riigi sellise kauplemiskoha tunnuskood, kus tehing tehti. Kasutage ISO 10383 segmendi MICi. Kui segmendi MIC puudub, kasutage korraldaja MICi. Kui tehingut ei tehta kolmanda riigi kauplemiskohas, siis lahtrit ei täideta.	APA	{MIC}
15	Avalikustamise kuupäev ja kellaaeg	Kõikide finantsinstrumentide puhul	Kuupäev ja kellaaeg, millal kauplemiskoht või tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja tehingu avalikustas. Kauplemiskohas tehtud tehingute puhul on detailsuse tase kooskõlas delegeeritud määruse (EL) 2025/1155 artiklis 12 sätestatud nõuetega. Tehingute puhul, mida ei tehtud kauplemiskohas, esitatakse kellaaeg vähemalt lähima sekundi täpsusega.	RM, MTF, OTF, APA	{DATE_TIME_ FORMAT}
16	Avalikustamise koht	Kõikide finantsinstrumentide puhul	Kood, mida kasutatakse tehingut avalikustava kauplemiskoha või tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja tuvastamiseks.	RM, MTF, OTF, APA	{MIC}
17	Tehingu tunnuskood	Kõikide finantsinstrumentide puhul	Tähtnumbriline kood, mille on määranud kauplemiskohad (kooskõlas komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/580 ([2]) artikliga 12) ja tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustajad ning mida kasutatakse edaspidi mis tahes viitamisel konkreetsele tehingule.	RM, MTF, OTF, APA	{ALPHA NUMERICAL-52}
18	Kliiritav tehing	Tuletisinstrumentide puhul	Kood, millega tähistatakse see, kas tehing kliiritakse.	RM, MTF, OTF, APA	„TRUE” – tehing kliiritakse „FALSE” – tehingut ei kliirita

▼M4

Nr	Lahtri tähis	Finantsinstrumendid	Kirjeldus ja avaldatavad andmed	Täitmis- või avaldamiskoha liik	Kasutatav vorming, nagu on täpsustatud tabelis 1
19	Märgised	Kõikide finantsinstrumentide puhul	Ühte või mitmesse lahtrisse tuleks lisada asjakohased märgised, nagu on kirjeldatud II lisa tabelis 3. Kui ei kehti ükski kindlaksmääratud asjaoludest, tuleks tehing avaldada ilma märgiseta. Kui võimalikud on mitu märgist ja need esitatakse ühes lahtris, tuleks märgised eraldada komadega.	RM, MTF, OTF, APA	Nagu on täpsustatud II lisa tabelis 3
20	Kauplemissüsteem	Kõikide finantsinstrumentide puhul	Selle kauplemissüsteemi liik, kus tehing tehti. Kui lahtrisse „Täitmiskoht” on märgitud „SINT” või „XOFF”, jäetakse see lahter tühjaks.	RM, MTF, OTF	„CLOB” – keskse piirangutega tellimusraamatu põhine kauplemissüsteem. „QDTS” – noteeringupõhine kauplemissüsteem ehk süsteem, kus tehingud sõlmitakse fikseeritud noteeringute alusel, mis tehakse osalistele pidevalt kättesaadavaks, ning mis nõuab turutegijatelt sellises mahus noteeringute hoidmist, mis tasakaalustab liikmete ja osaliste vajaduse kaubelda ärilises mahus ning turutegija riski. „PATS” – perioodioksjonipõhine kauplemissüsteem. „RFQT” – hinnapäringupõhine kauplemissüsteem ehk kauplemissüsteem, kus hinnapakkumine või -pakkumised esitatakse vastusena hinnapäringule, mille on esitanud üks või mitu teist liiget või osalejat. Hinnapakkumist saab kasutada üksnes päringu teinud liige või turuosaline. Hinnapäringu esitanud liige või osaleja võib teha tehingu, aktsepteerides talle päringu alusel tehtud hinnapakkumise või -pakkumised.

▼M4

Nr	Lahtri tähis	Finantsinstrumendid	Kirjeldus ja avaldatavad andmed	Täitmis- või avaldamiskoha liik	Kasutatav vorming, nagu on täpsustatud tabelis 1
					„VOIC” – häälkauplemissüsteem ehk kauplemissüsteem, kus liikmetevahelised tehingud toimuvad häälega peetavate läbirääkimiste kaudu. „HYBR” – hübriidkauplemissüsteem ehk süsteem, mida saaks liigitada kahte või enamasse eespool osutatud kauplemissüsteemi liiki. „OTHR” – mis tahes muu kauplemissüsteem ehk eespool kajastamata mis tahes muud liiki kauplemissüsteem.
21	Tehingute arv	Riigi võlakohustuste puhul	Sellesse lahtrisse tuleks märkida tehtud tehingute arv, kui määruse (EL) nr 600/2014 artikli 11 lõike 3 punkti b kohaselt nõutakse mitme tehingu üksikasjade kokkuvõtlikul kujul avalikustamisega viivitamist.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/17}.

(1) Komisjoni 12. juuni 2025. aasta delegeeritud määrus (EL) 2025/1155, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, millega määratakse kindlaks kauplemiskoondteabe sisend- ja väljundandmed, äritegevuses kasutatavate kellade sünkroonimine ning tulude ümberjaotamine aktsiate ja börsil kaubeldavate fondide kauplemiskoondteabe pakkuja poolt, ning tunnistatakse kehtetuks komisjoni delegeeritud määrus (EL) 2017/574 (ELT L, 2025/1155, 3.11.2025, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2025/1155/oj).

(2) Komisjoni 24. juuni 2016. aasta delegeeritud määrus (EL) 2017/580, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad finantsinstrumentidega seotud korralduste asjaomaste andmete säilitamist (ELT L 87, 31.3.2017, lk 193, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/580/oj).

▼M4

Tabel 3

Kauplemisjärgse läbipaistvuse eesmärgil kasutatavate märgiste loetelu

KAUPLEMISJÄRGSE VIIVITUSE MÄRGISED TULETISINSTRUMENTIDE PUHUL			
Märgis	Nimetus	Täitmis- või avaldamiskoha liik	Kirjeldus
„LRGS”	Kauplemisjärgse suuremahulise tehingu märgis	RM, MTF, OTF, APA	Tehingud, mis on tehtud suuremahuliste tehingute kauplemisjärgset viivitust kohaldades
„ILQD”	Mittelikviidse instrumendi tehingu märgis	RM, MTF, OTF, APA	Tehingud, mis on tehtud selliste instrumentide viivitust kohaldades, millel ei ole likviidset turgu
„SIZE”	Kauplemisjärgse instrumendile omase mahuga tehingu märgis	RM, MTF, OTF, APA	Tehingud, mis on tehtud instrumendile omase mahu puhul kauplemisjärgset viivitust kohaldades

KAUPLEMISJÄRGSE VIIVITUSE MÄRGISED VÕLAKIRJADE (V.A BÖRSIL KAUBELDAVATE KAUPADE JA BÖRSIL KAUBELDAVATE VÕLAKIRJADE) PUHUL			
Märgis	Nimetus	Täitmis- või avaldamiskoha liik	Kirjeldus
„MLF1”	Keskmise mahu likviidse turu märgis	RM, MTF, OTF, APA	Võlakirjadega tehtavad tehingud, mille puhul saab kasutada viivitust, mida kohaldatakse keskmises mahus tehingute suhtes finantsinstrumendiga, millel on likviidne turg, kooskõlas käesoleva määruse artikli 8a lõike 1 punktiga a.
„MIF2”	Keskmise mahu mittelikviidse turu märgis	RM, MTF, OTF, APA	Võlakirjadega tehtavad tehingud, mille puhul saab kasutada viivitust, mida kohaldatakse keskmises mahus tehingute suhtes finantsinstrumendiga, millel puudub likviidne turg, kooskõlas käesoleva määruse artikli 8a lõike 1 punktiga b.
„LLF3”	Suure mahu likviidse turu märgis	RM, MTF, OTF, APA	Võlakirjadega tehtavad tehingud, mille puhul saab kasutada viivitust, mida kohaldatakse suures mahus tehingute suhtes finantsinstrumendiga, millel on likviidne turg, kooskõlas käesoleva määruse artikli 8a lõike 1 punktiga c.
„LIF4”	Suure mahu mittelikviidse turu märgis	RM, MTF, OTF, APA	Võlakirjadega tehtavad tehingud, mille puhul saab kasutada viivitust, mida kohaldatakse suures mahus tehingute suhtes finantsinstrumendiga, millel puudub likviidne turg, kooskõlas käesoleva määruse artikli 8a lõike 1 punktiga d.

▼M4

KAUPLEMISJÄRGSE VIIVITUSE MÄRGISED VÕLAKIRJADE (V.A BÖRSIL KAUBELDAVATE KAUPADE JA BÖRSIL KAUBELDAVATE VÕLAKIRJADE) PUHUL

Märgis	Nimetus	Täitmis- või avaldamiskoha liik	Kirjeldus
„VLF5”	Väga suure mahu likviidse turu märgis	RM, MTF, OTF, APA	Võlakirjadega tehtavad tehingud, mille puhul saab kasutada viivitust, mida kohaldatakse väga suures mahus tehingute suhtes finantsinstrumendiga, millel on likviidne turg, kooskõlas käesoleva määruse artikli 8a lõike 1 punktiga e.
„VIF5”	Väga suure mahu mittelikviidse turu märgis	RM, MTF, OTF, APA	Võlakirjadega tehtavad tehingud, mille puhul saab kasutada viivitust, mida kohaldatakse väga suures mahus tehingute suhtes finantsinstrumendiga, millel puudub likviidne turg, kooskõlas käesoleva määruse artikli 8a lõike 1 punktiga e.

KAUPLEMISJÄRGSE VIIVITUSE MÄRGISED BÖRSIL KAUBELDAVATE KAUPADE, BÖRSIL KAUBELDAVATE VÕLAKIRJADE, STRUKTUREERITUD FINANTSTOODETE JA LUBATUD HEITKOGUSTE VÄÄRTPABERITE PUHUL

Märgis	Nimetus	Täitmis- või avaldamiskoha liik	Kirjeldus
DEFF	Viivitus börsil kaubeldavate kaupade, börsil kaubeldavate võlakirjade, struktureeritud finantstoodete ja lubatud heitkoguste väärtpaberite puhul	RM, MTF, OTF, APA	Börsil kaubeldavate kaupade, börsil kaubeldavate võlakirjade, struktureeritud finantstoodete ja lubatud heitkoguste väärtpaberitega tehtud tehingud, mille suhtes kohaldatakse käesoleva määruse artikli 8a lõigetes 2 ja 3 sätestatud viivitust.

TÄIENDAVA VIIVITUSE MÄRGISED TULETISINSTRUMENTIDE PUHUL

Artikli 11 lõike 1 punkti a alapunkt i	„LMTF”	Piiratud andmete märgis	RM, MTF, OTF, APA	Esimeses aruandes avalikustatakse piiratud andmed kooskõlas artikli 11 lõike 1 punkti a alapunktiga i.
	„FULF”	Täielike andmete märgis	RM, MTF, OTF, APA	Tehingud, mille piiratud andmed on varem avalikustatud kooskõlas artikli 11 lõike 1 punkti a alapunktiga i.
Artikli 11 lõike 1 punkti a alapunkt ii	„DATF”	Päevaste tehingute koondandmete märgis	RM, MTF, OTF, APA	Päevaste tehingute koondandmete avalikustamine kooskõlas artikli 11 lõike 1 punkti a alapunktiga ii.
	„FULA”	Täielike andmete märgis	RM, MTF, OTF, APA	Üksikud tehingud, mille koondandmed on varem avalikustatud kooskõlas artikli 11 lõike 1 punkti a alapunktiga ii.

▼M4

TÄIENDAVA VIIVITUSE MÄRGISED TULETISINSTRUMENTIDE PUHUL				
Artikli 11 lõike 1 punkt b	„VOLO”	Mahu ärajätmise märgis	RM, MTF, OTF, APA	Tehing, mille piiratud andmed avalikustatakse kooskõlas artikli 11 lõike 1 punktiga b.
	„FULV”	Täielike andmete märgis	RM, MTF, OTF, APA	Tehing, mille piiratud andmed on varem avalikustatud kooskõlas artikli 11 lõike 1 punktiga b.
Artikli 11 lõike 1 punkt c	„FWAF”	Nelja nädala koondandmete märgis	RM, MTF, OTF, APA	Tehingute koondandmete avalikustamine kooskõlas artikli 11 lõike 1 punktiga c.
	„FULJ”	Täielike andmete märgis	RM, MTF, OTF, APA	Üksikud tehingud, mille puhul on varem lubatud kasutada koondandmete avaldamist kooskõlas artikli 11 lõike 1 punktiga c.

TÄIENDAVA VIIVITUSE MÄRGISED RIIGIVÕLAKIRJADE PUHUL				
Artikli 11 lõike 3 punkt a	„OMIS”	Mahu ärajätmise märgis	RM, MTF, OTF, APA	Tehing, mille piiratud andmed avalikustatakse kooskõlas määruse (EL) nr 600/2014 artikli 11 lõike 3 punktiga a.
	„FULO”	Täielike andmete märgis	RM, MTF, OTF, APA	Tehing, mille piiratud andmed on varem avalikustatud kooskõlas määruse (EL) nr 600/2014 artikli 11 lõike 3 punktiga a.
Artikli 11 lõike 3 punkt b	„AGFW”	Nelja nädala koondandmete märgis	RM, MTF, OTF, APA	Tehingute koondandmete avalikustamine kooskõlas määruse (EL) nr 600/2014 artikli 11 lõike 3 punktiga b.
	„FULG”	Täielike andmete märgis	RM, MTF, OTF, APA	Üksikud tehingud, mille puhul on varem lubatud kasutada koondandmete avaldamist kooskõlas määruse (EL) nr 600/2014 artikli 11 lõike 3 punktiga b.

MUUD MÄRGISED			
Märgis	Nimetus	Täitmis- või avaldamiskoha liik	Kirjeldus
„BENC”	Võrdlustehingu märgis	RM, MTF, OTF, APA	Tehingud, mis on tehtud viitega hinnale, mis on arvutatud mitme ajapunkti kohta vastavalt teatavale võrdlusalusele, nagu mahuga kaalutud keskmine hind või ajaga kaalutud keskmine hind.
„NPFT”	Hinda mittekujundava tehingu märgis	RM, MTF, OTF, APA	Hinda mittekujundavad tehingud, nagu on sätestatud delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 2 lõikes 5.

▼M4

MUUD MÄRGISED

Märgis	Nimetus	Täitmis- või avaldamiskoha liik	Kirjeldus
„TPAC”	Kombineeritud tehingu märgis	RM, MTF, OTF, APA	Kombineeritud tehingud, mille puhul ei ole tegemist materiaalse vara vastu vahetusega, nagu on määratletud määruse (EL) nr 600/2014 artikli 2 lõike 1 punkti 50 alapunktis b.
„XFPH”	Materiaalse vara vastu vahetuse märgis	RM, MTF, OTF, APA	Materiaalse vara vastu vahetus, nagu on määratletud määruse (EL) nr 600/2014 artikli 2 lõike 1 punktis 48.
„CANC”	Tühistamismärgis	RM, MTF, OTF, APA	Varem avalikustatud tehingu tühistamise korral.
„AMND”	Muutmismärgis	RM, MTF, OTF, APA	Varem avalikustatud tehingu muutmise korral.
„PORT”	Portfellitehingu märgis	RM, MTF, OTF, APA	Viie või enama erineva finantsinstrumendiga tehtav tehing, mida teeb sama klient samal ajal ja ühtse kogumihinnaga ning mis ei ole määruse (EL) nr 600/2014 artikli 2 lõike 1 punktis 50 määratletud pakett-tehing.
„MTCH”	Kliendikorralduste sobitamistehingu märgis	OTF	Kliendikorralduste sobitamistehingud, nagu on sätestatud direktiivi 2014/65/EL artikli 4 lõike 1 punktis 38.
„NEGO”	Määratud vastaspoolega väärtpaberitehingu märgis	RM, MTF, OTF	Tehingud, mis räägitakse läbi kahepoolselt, kuid millest teatatakse kauplemiskoha eeskirjade kohaselt.

▼M3

Tabel 4

Mahu mõõtmine

Instrumendi liik	Maht
Kõik võlakirjad, v.a börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad ning struktureeritud finantstooted	Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10.
Börsil kaubeldavate kaupade ja börsil kaubeldavate võlakirjade liigid	Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10.
Väärtpaberistatud tuletisinstrumendid	Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10.
Intressimäära tuletisinstrumendid	Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10.
Välisvaluuta tuletisinstrumendid	Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10.
Aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid	Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10.
Kauba tuletisinstrumendid	Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10.
Krediidituletisinstrumendid	Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10.
Hinnavaheleping	Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10.
C10 tuletisinstrumendid	Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10.
Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid	Kogus mõõtühikutes vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 8.
Lubatud heitkoguste väärtpaberid	Kogus mõõtühikutes vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 8.

▼B

III LISA

Likviidsuse hindamine, künnised mittekapitaliinstrumentide jaoks suure mahu ja instrumendile omase mahu puhul

▼M4

1. **Juhised lisa kohaldamiseks**

1. Viide võlakirjade lunastamata emissioonimahule tabelis 2.2 viitab emiteeritud ja praegu investorite hoitavate võlakirjade koguväärtusele.

2. Viide „varaklassile” tähendab viidet järgmistele finantsinstrumentide klassidele: võlakirjad, struktureeritud finantstooted, väärtpaberistatud tuletisinstrumendid, intressimäära tuletisinstrumendid, aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid, kauba tuletisinstrumendid, välisvaluuta tuletisinstrumendid, krediidituletisinstrumendid, C10 tuletisinstrumendid, hinnavahelepingud, lubatud heitkoguste väärtpaberid ja lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid.

3. Viide „varade alamklassile” tähendab viidet varaklassile, mis on detailsemalt segmenteeritud, tuginedes lepingu ja/või alusvara liigile.

4. Viide „alamklassile” tähendab viidet varade alamklassile, mis on detailsemalt segmenteeritud täiendavate kvalitatiivsete segmenteerimiskriteeriumide alusel, nagu on sätestatud selle lisa tabelites 2.2–13.3.

5. „Keskmine päevane tinglik väärtus” tähendab asjaomase finantsinstrumendi tinglikku koguväärtust, mis määratakse kindlaks kooskõlas mahunäitajaga, mis on sätestatud II lisa tabelis 4 ja saadud artikli 13 lõikes 7 sätestatud ajavahemiku jooksul, jagatuna selle perioodi kauplemispäevade arvuga, või kui see on asjakohane, siis selle osaga aastast, mille jooksul finantsinstrument võeti kauplemisele või sellega kaubeldi kauplemiskohas ning sellega kauplemist ei peatatud.

6. „Keskmine päevane tehingute arv” tähendab asjaomase finantsinstrumendiga tehtud tehingute koguarvu artikli 13 lõikes 7 sätestatud perioodil jagatuna selle perioodi kauplemispäevade arvuga, või kui see on asjakohane, siis selle osaga aastast, mille jooksul finantsinstrument võeti kauplemisele või sellega kaubeldi kauplemiskohas ning sellega kauplemist ei peatatud.

7. „Futuur” tähendab lepingut kauba või finantsinstrumendi ostuks või müügiks kindlaksmääratud tulevasel kuupäeval lepingu sõlmimisel ostja ja müüja vahel kokku lepitud hinnaga. Igal futuurlepingul on standardtingimused, mis määravad miinimumkoguse ja -kvaliteedi, mida võib osta või müüa, väikseima summa, mille võrra hind võib muutuda, kättetoimetamise korra, tähtaja ning muud lepinguga seotud omadused.

8. „Optsioon” tähendab lepingut, mis annab omanikule õiguse, aga ei pane kohustust osta (ostuoptsioon) või müüa (müügioptsioon) teatavat finantsinstrumenti või kaupa eelnevalt kindlaksmääratud hinnaga või täitmishinnaga teataval tulevasel kuupäeval või täitmiskuupäeval või kuni sellise kuupäevani.

9. „Vahetustehing” tähendab lepingut, mille kaks poolt lepivad kokku ühe finantsinstrumendi rahavoogude vahetamises teise finantsinstrumendi rahavoogude vastu teataval tulevasel kuupäeval.

10. „Portfellivahetustehing” tähendab lepingut, mille alusel lõppkasutajad saavad kaubelda mitme vahetuslepinguga.

▼**M4**

11. „Forvard” või „forvardleping” tähendab kahe poole vahelist eralepingut kauba või finantsinstrumendi ostuks või müügiks kindlaksmääratud tulevasel kuupäeval lepingu sõlmimisel ostja ja müüja vahel kokku lepitud hinnaga.

12. „Vahetusoptsioon” või „vahetustehingu optsioon” tähendab optsioonilepingut, mis annab omanikule õiguse, aga ei pane kohustust sõlmida vahetustehing teataval tulevasel kuupäeval või kuni sellise kuupäevani.

13. „Vahetustehingu futuur” tähendab futuurlepingut, mis paneb omanikule kohustuse sõlmida vahetustehing teataval tulevasel kuupäeval või kuni sellise kuupäevani.

14. „Vahetustehingu forvard” tähendab forvardlepingut, mis paneb omanikule kohustuse sõlmida vahetustehing teataval tulevasel kuupäeval või kuni sellise kuupäevani.

▼M4

2. **Võlakirjad**

Tabel 2.2

Võlakirjad (kõik võlakirjaliigid, v.a börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad) – klassid, millel ei ole likviidset turgu

Iga üksiku võlakirja puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu artikli 6a kohaselt, kui seda iseloomustab teatav võlakirja omaduste kombinatsioon, mis on täpsustatud allpool igal tabelite real.

Riigivõlakirjad ja muud avaliku sektori võlakirjad						
Rühma tunnus	**MiFIRi kohane tunnus**	**Võlakirjaliik**	**Emitent või emitendi riik**	**Järelejäänud tähtaeg**	**Kupongimäära liik**	**Lunastamata emissioonimaht**
	RTS2#3	RTS2#9	Komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/585 (1) (edaspidi „RTS23”) väljal „Emitendi või kauplemiskoha korraldaja tunnus” esitatud emitendi riik	RTS23 väljal „Lõpptähtaeg” esitatud lõpptähtajani jäänud aeg	RTS23 väljal „Instrumendi liigitus” esitatud CFI-koodi kolmas täht	RTS23 väljal „Emiteeritud nimiväärtus kokku” esitatud väärtus ümber arvestatuna eurodesse
G1	BOND	EUSB „EUSB” tähendab võlakirja, mis ei ole vahetusvõlakiri ega pandikiri ja mille on emiteerinud avaliku sektori emitent: a) liit; b) liikmesriik, k.a liikmesriigi valitsusasutus, amet või eriotstarbeline üksus; c) liitriigist liikmesriigi puhul liitriigi liige; d) mitme liikmesriigi eriotstarbeline üksus; e) rahvusvaheline finantsasutus, mille on asutanud vähemalt kaks liikmesriiki ja mille eesmärk on koondada rahalisi vahendeid ning anda rahalist abi oma liikmetele, kellel on või keda ohustavad ulatuslikud finantsprobleemid; f) Euroopa Investeerimispank; g) kolmanda riigi suveräänne üksus.	Emitent on liikmesriik, Ameerika Ühendriigid või Ühendkuningriik VÕI emitent on liit.	Kuni ja kaasa arvatud 10 aastat	F (fikseeritud kupongimäär)	Alla 5 000 000 000 euro
G2	BOND	EUSB või OEPB „OEPB” tähendab võlakirja, mis ei ole vahetusvõlakiri ega pandikiri ja mille on emiteerinud avaliku sektori üksus, kes ei ole avaliku sektori emitent.	Mis tahes instrument, mis ei kuulu rühma G1			Alla 1 000 000 000 euro

(1) Komisjoni 14. juuli 2016. aasta delegeeritud määrus (EL) 2017/585, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad finantsinstrumentide võrdlusandmete standardeid ja vorme ning tehnilisi meetmeid, mis on seotud ESMA ja pädevate asutuste kehtestatava korraga (ELT L 87, 31.3.2017, lk 368, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/585/oj).

▼M4

Äriühingu võlakirjad, vahetusvõlakirjad ja muud võlakirjad					
Rühma tunnus	**MiFIRi kohane tunnus**	**Võlakirjaliik**	**Valuuta**	**Krediidireiting**	**Lunastamata emissioonimaht**
	RTS2#3	RTS2#9	RT23 väljal „Tinglik valuuta 1” esitatud instrumendi valuuta		RTS23 väljal „Emiteeritud nimiväärtus kokku” esitatud väärtus ümber arvestatuna eurodesse
G3	BOND	CRPB, CVTB või OTHR „CRPB” tähendab võlakirja, mis ei ole vahetusvõlakiri ega pandikiri ja mille on emiteerinud Euroopa äriühing, mis on asutatud kooskõlas nõukogu määrusega (EÜ) nr 2157/2001, ([1]) või Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2013/34/EL ([2]) I või II lisas loetletud liiki äriühing või samaväärne äriühing kolmandates riikides. „CVTB” tähendab instrumenti, mis koosneb võlakirjast või väärtpaberistatud võlainstrumendist koos varjatud tuletisinstrumendiga, nt optsioon osta alusaktsia.	EUR, GBP, USD	Investeerimisjärgu krediidireiting	Alla 500 000 000 euro
G4	BOND	CRPB, CVTB või OTHR	Mis tahes instrument, mis ei kuulu rühma G3		Alla 500 000 000 euro

([1]) Nõukogu 8. oktoobri 2001. aasta määrus (EÜ) nr 2157/2001 Euroopa äriühingu (SE) põhikirja kohta (EÜT L 294, 10.11.2001, lk 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2001/2157/oj).
([2]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 26. juuni 2013. aasta direktiiv 2013/34/EL teatavat liiki ettevõtjate aruandeaasta finantsaruannete, konsolideeritud finantsaruannete ja nendega seotud aruannete kohta ja millega muudetakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2006/43/EÜ ning tunnistatakse kehtetuks nõukogu direktiivid 78/660/EMÜ ja 83/349/EMÜ (ELT L 182, 29.6.2013, lk 19, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2013/34/oj).

Pandikirjad			
Rühma tunnus	**MiFIRi kohane tunnus**	**Võlakirjaliik**	**Lunastamata emissioonimaht**
	RTS2#3	RTS2#9	RTS23 väljal „Emiteeritud nimiväärtus kokku” esitatud väärtus ümber arvestatuna eurodesse
G5	BOND	CVDB „CVDB” tähendab võlakirju, millele on osutatud Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2009/65/EÜ ([1]) artikli 52 lõikes 4	Alla 500 000 000 euro

([1]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 13. juuli 2009. aasta direktiiv 2009/65/EÜ vabalt võõrandatavatesse väärtpaberitesse ühiseks investeeringuks loodud ettevõtjaid (eurofondid) käsitlevate õigus- ja haldusnormide kooskõlastamise kohta (ELT L 302, 17.11.2009, lk 32, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2009/65/oj).

▼M4

Tabel 2.3

Võlakirjad (kõik võlakirjaliigid, v.a börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad) – kauplemiseelsed künnised suure mahu puhul

Varaklass – võlakirjad (kõik võlakirjaliigid, v.a börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad)	
Võlakirjaliik	**Kauplemiseelne suur maht**
Riigivõlakirjad ja muud avaliku sektori võlakirjad	5 000 000 eurot
Äriühingu võlakirjad, vahetusvõlakirjad ja muud võlakirjad	1 000 000 eurot
Pandikiri	5 000 000 eurot

Tabel 2.4

Võlakirjad (börsil kaubeldavate kaupade ja börsil kaubeldavate võlakirjade liiki võlakirjad) – klassid, millel ei ole likviidset turgu

Varaklass – võlakirjad (börsil kaubeldavate kaupade ja börsil kaubeldavate võlakirjade liiki võlakirjad)	
Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana vastavalt artiklile 6a, kasutatakse järgmist metoodikat.	
Börsil kaubeldavad kaubad – RTS2#3 = ETCS: võlainstrument, mis on emiteeritud otseinvesteeringu vastu, mille emitent on teinud kaupadesse või kauba tuletislepingutesse. Börsil kaubeldava kauba hind on otse või kaudselt seotud alusvara tootlusega. Börsil kaubeldav kaup kajastab passiivselt selle kauba või kauba indeksi tootlust, millega ta seotud on.	Kõiki börsil kaubeldavaid kaupu käsitatakse likviidset turgu mitteomavana
Börsil kaubeldavad võlakirjad – RTS2#3 = ETNS: võlainstrument, mis on emiteeritud otseinvesteeringu vastu, mille emitent on teinud alusvarasse või aluseks olevatesse tuletislepingutesse. Börsil kaubeldava võlakirja hind on otse või kaudselt seotud alusvara tootlusega. Börsil kaubeldav võlakiri kajastab passiivselt selle alusvara tootlust, millega ta seotud on.	Kõiki börsil kaubeldavaid võlakirju käsitatakse likviidset turgu mitteomavana

Tabel 2.5

Võlakirjad (börsil kaubeldavate kaupade ja börsil kaubeldavate võlakirjade liiki võlakirjad) – kauplemiseelne künnis suure mahu puhul

Varaklass – võlakirjad (börsil kaubeldavate kaupade ja börsil kaubeldavate võlakirjade liiki võlakirjad)	
Võlakirjaliik	**Kauplemiseelne suur maht**
Börsil kaubeldavad kaubad	1 000 000 eurot
Börsil kaubeldavad võlakirjad	1 000 000 eurot

▼M4

Tabel 2.6

Võlakirjad (kõik võlakirjaliigid, v.a börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad) – avalikustamisega viivitamise kord

Varaklass – võlakirjad (kõik võlakirjaliigid, v.a börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad)			
Võlakirjaliik	**Kategooria**	**Likviidsus**	**Suurus (suurem või võrdne)**
Tabeli 2.2 rühma G1 riigivõlakiri	1	Käsitatakse likviidset turgu omavana	15 000 000 eurot
	2	Käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	5 000 000 eurot
	3	Käsitatakse likviidset turgu omavana	50 000 000 eurot
	4	Käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	15 000 000 eurot
	5	Käsitatakse likviidset turgu omavana	100 000 000 eurot
	5	Käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	50 000 000 eurot
Riigivõlakiri või tabeli 2.2 rühma G2 muu avaliku sektori võlakiri	1	Käsitatakse likviidset turgu omavana	10 000 000 eurot
	2	Käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	1 000 000 eurot
	3	Käsitatakse likviidset turgu omavana	20 000 000 eurot
	4	Käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	2 000 000 eurot
	5	Käsitatakse likviidset turgu omavana	50 000 000 eurot
	5	Käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	5 000 000 eurot
Tabeli 2.2 rühma G3 äriühingu võlakiri, vahetusvõlakiri või muu võlakiri	1	Käsitatakse likviidset turgu omavana	1 500 000 eurot
	2	Käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	500 000 eurot
	3	Käsitatakse likviidset turgu omavana	7 500 000 eurot
	4	Käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	2 000 000 eurot
	5	Käsitatakse likviidset turgu omavana	15 000 000 eurot
	5	Käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	5 000 000 eurot

▼M4

Varaklass – võlakirjad (kõik võlakirjaliigid, v.a börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad)			
Võlakirjaliik	**Kategooria**	**Likviidsus**	**Suurus (suurem või võrdne)**
Tabeli 2.2 rühma G4 äriühingu võlakiri, vahetusvõlakiri või muu võlakiri	1	Käsitatakse likviidset turgu omavana	1 000 000 eurot
	2	Käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	500 000 eurot
	3	Käsitatakse likviidset turgu omavana	5 000 000 eurot
	4	Käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	2 000 000 eurot
	5	Käsitatakse likviidset turgu omavana	10 000 000 eurot
	5	Käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	5 000 000 eurot
Tabeli 2.2 rühma G5 pandikirjad	1	Käsitatakse likviidset turgu omavana	5 000 000 eurot
	2	Käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	1 000 000 eurot
	3	Käsitatakse likviidset turgu omavana	20 000 000 eurot
	4	Käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	5 000 000 eurot
	5	Käsitatakse likviidset turgu omavana	50 000 000 eurot
	5	Käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	10 000 000 eurot

3. **Struktureeritud finantstooted**

Tabel 3.1

Struktureeritud finantstooted – klassid, millel ei ole likviidset turgu

Varaklass – struktureeritud finantstooted
Struktureeritud finantstoodete varaklassi hindamine selliste finantsinstrumentide kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse artikli 6a järgi likviidset turgu mitteomavana – RTS2#3 = SFPS.
Kõiki struktureeritud finantstooteid käsitatakse likviidset turgu mitteomavana

Tabel 3.2

Struktureeritud finantstooted – kauplemiseelne künnis suure mahu puhul

Varaklass – struktureeritud finantstooted
Kauplemiseelne suur maht
250 000 eurot

▼B

4. **Väärtpaberistatud tuletisinstrumendid**

▼M3

Tabel 4.1

Väärtpaberistatud tuletisinstrumendid – klassid, millel ei ole likviidset turgu

Varaklass – väärtpaberistatud tuletisinstrumendid
Vabalt võõrandatavad väärtpaberid, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL artikli 4 lõike 1 punkti 44 alapunktis c, mis erinevad struktureeritud finantstoodetest ja hõlmavad vähemalt järgmist:
a.1) kaetud lihtostutähed (*plain vanilla covered warrants*) – finantsasutuse emiteeritud väärtpaberid, mis annavad omanikule õiguse, aga ei pane kohustust a) osta aegumistähtajal või aegumistähtajaks teatavas koguses alusvara eelnevalt kindlaks määratud täitmishinnaga või juhul, kui sularahas arveldus on fikseeritud, siis saama hetke turuhinna ja täitmishinna positiivse vahe makse, või b) müüa aegumistähtajal või aegumistähtajaks teatavas koguses alusvara eelnevalt kindlaks määratud täitmishinnaga või juhul, kui sularahas arveldus on fikseeritud, saama täitmishinna ja hetke turuhinna positiivse vahe makse ostjalt;
a.2) ostutähed (*warrants*) – sama alusvaraemitendi emiteeritud väärtpaberid, mis annavad omanikule õiguse, aga ei pane kohustust a) osta aegumistähtajal või aegumistähtajaks teatavas koguses alusvara eelnevalt kindlaks määratud täitmishinnaga või juhul, kui sularahas arveldus on fikseeritud, siis saama hetke turuhinna ja täitmishinna positiivse vahe makse, või b) müüa aegumistähtajal või aegumistähtajaks teatavas koguses alusvara eelnevalt kindlaks määratud täitmishinnaga või juhul, kui sularahas arveldus on fikseeritud, saama täitmishinna ja hetke turuhinna positiivse vahe makse ostjalt;
b) finantsvõimenduse tunnistused (leverage certificates) – tunnistused, mis kajastavad alusvara tootlust koos finantsvõimenduse mõjuga;
c) eksootilised kaetud ostutähed (*exotic covered warrants*) – kaetud ostutähed, mille põhikomponent on optsioonide kombinatsioon;
d) kaubeldavad õigused, mille alusvara on mittekapitaliinstrument;
e) investeerimistunnistused – tunnistused, mis kajastavad alusvara tootlust ilma finantsvõimenduse mõjuta.
RTS2#3 = SDRV
Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat
Kõiki väärtpaberistatud tuletisinstrumente käsitatakse likviidset turgu omavana

▼M4

Tabel 4.2

Väärtpaberistatud tuletisinstrumendid– kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul

Varaklass – väärtpaberistatud tuletisinstrumendid		
Kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul		
Suur maht, kauplemiseelne	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
60 000 eurot	90 000 eurot	100 000 eurot

▼B

5. **Intressimäära tuletisinstrumendid**

▼M3

Tabel 5.1

Intressimäära tuletisinstrumendid – klassid, millel ei ole likviidset turgu

Varaklass – intressimäära tuletisinstrumendid				
Mis tahes leping, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktis 4, mille lõplik alusvara on intressimäär, võlakiri, laen; mis tahes korv, portfell või indeks, mis hõlmab intressimäära, võlakirja, laenu, või muu toode, mis esindab intressimäära, võlakirja või laenu tootlust.				
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi**		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
Võlakirjafutuurid/-forvardid / võlakirjafutuuri futuur	Võlakirjafutuuri/-forvardi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS2#17) – alusvara emitent **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#18) – alusvaraks oleva ülekantava võla-	5 000 000 eurot	10	Kui alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel on likviidne turg teatava järelejäänud tähtaja klassi puhul, ja alamklassi puhul, mis on

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
/ võlakirjafutuuri forvardVõlakirjafutuur **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = BOND** **või** **Võlakirjaforvard** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FORW** **RTS2#16 = BOND** **või** **Võlakirjafutuuri futuur** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR**	**Lühiajaline:** alusvaraks olev ülekantav võlakiri tähtajaga kuni 4 aastat loetakse lühiajaliseks **Keskmise tähtajaga:** alusvaraks olev ülekantav võlakiri tähtajaga 4–8 aastat loetakse keskmise tähtajaga võlakirjaks **Pikaajaline:** alusvaraks olev ülekantav võlakiri tähtajaga 8–15 aastat loetakse pikaajaliseks **Väga pikaajaline:** alusvaraks olev ülekantav võlakiri tähtajaga rohkem kui 15 aastat loetakse väga pikaajaliseks **Segmenteerimiskriteerium 3 –** futuuri järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud Tähtajaklass 2: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud Tähtajaklass 3: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta Tähtajaklass 4: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat Tähtajaklass 5: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat			määratletud järgmise järelejäänud tähtaja klassiga,määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu, määratakse esimese järgneva lepingu (*back month) puhul kindlaks, et sellel on likviidne turg, kaks nädalat enne kehtiva lepingu (front month) lõppu*

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
RTS2#5 = FUTR **RTS2#16 = BNFD** **või** **Võlakirjafutuuri forvard** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FORW** **RTS2#16 = BNFD**				
Võlakirjaoptsioon **/ võlakirjaoptsiooni optsioon** **/ võlakirjafutuuri optsioon** **Võlakirjaoptsioon** **Võlakirjaoptsiooni optsioon** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR**	Võlakirjaoptsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS2#22) – lõplik alusvaraks olev võlakiri **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – optsiooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud Tähtajaklass 2: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud Tähtajaklass 3: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta Tähtajaklass 4: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat Tähtajaklass 5: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	5 000 000 eurot	10	

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
RTS2#5 = OPTN **RTS2#16 = BOND** **või** **Võlakirjaoptsiooni optsioon** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = BOND** **või** **Võlakirjafutuuri optsioon** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = BNFD**				

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
Intressimäärafutuurid ja intressiforvardid / intressimäärafutuuri futuur / intressimäärafutuuri intressiforvard **Intressimäärafutuur** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = INTR** **või** **Intressiforvard** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FRAS** **RTS2#16 = INTR** **või** **Intressimäärafutuuri futuur**	Intressimäärafutuuri alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS2#24) – aluseks olev intressimäär **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#25) – aluseks oleva intressimäära tähtaeg **Segmenteerimiskriteerium 3** (RTS2#8) – futuuri järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud Tähtajaklass 2: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud Tähtajaklass 3: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta Tähtajaklass 4: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat Tähtajaklass 5: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	500 000 000 eurot	10	Kui alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel on likviidne turg teatava järelejäänud tähtaja klassi puhul, ja alamklassi puhul, mis on määratletud järgmise järelejäänud tähtaja klassiga, määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu, määratakse esimese järgneva lepingu (back month) puhul kindlaks, et sellel on likviidne turg, kaks nädalat enne kehtiva lepingu (front month) lõppu

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
RTS2#3 = DERV **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = IFUT** **või** **Intressimäärafutuuri intressiforvard** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FRAS** **RTS2#16 = IFUT**				
Intressimääraoptsioonid **/ intressimäärafutuuri/intressiforvardi optsioon** **/ intressimääraoptsiooni optsioon**	Intressimääraoptsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS2#24) – aluseks olev intressimäär **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#25) – aluseks oleva intressimäära tähtaeg **Segmenteerimiskriteerium 3** (RTS2#8) – optsiooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud	500 000 000 eurot	10	

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
/ intressimäärafutuuri/intressiforvardi optsiooni optsioon **Intressimäärafutuuri/intressiforvardi optsioon // Intressimääraoptsiooni optsioon** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = IFUT** **või** **Intressimääraoptsioon // Intressimäärafutuuri/intressiforvardi optsiooni optsioon** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = INTR**	Tähtajaklass 2: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud Tähtajaklass 3: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta Tähtajaklass 4: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat Tähtajaklass 5: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat			

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
Vahetusoptsioonid **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = SWPT**	Vahetusoptsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi: **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS2#16) – aluseks oleva vahetustehingu liik on määratletud järgmiselt: ühes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingud, ühes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid [**RTS2#16 = XXSC**] ühes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud, ühes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid [**RTS2#16 = XFSC**] ühes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud, ühes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid [**RTS2#16 = FFSC**] ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingud, ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forvardid [**RTS2#16 = IFSC**] ühes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingud, ühes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingute futuurid/forvardid [**RTS2#16 = OSSC**] mitmes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingud, mitmes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid [**RTS2#16 = XXMC**]	500 000 000 eurot	10	

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
	mitmes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud, mitmes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid [**RTS2#16 = XFMC**]			
	mitmes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud, mitmes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid [**RTS2#16 = FFMC**]			
	mitmes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingud, mitmes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forvardid [**RTS2#16 = IFMC**]			
	mitmes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingud, mitmes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingute futuurid/forvardid [**RTS2#16 = OSMC**]			
	Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#20) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles optsiooni tinglik väärtus on nomineeritud			
	Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#22 või RTS2#23) – inflatsiooniindeks, kui aluseks olev vahetustehing on kas ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehing või mitmes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehing			
	Segmenteerimiskriteerium 4 (RTS2#21) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:			
	Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu			
	Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud			

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
	Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta Tähtajaklass 5: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat Tähtajaklass 6: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat **Segmenteerimiskriteerium 5** (RTS2#8) – optsiooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: **Tähtajaklass 1:** 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud **Tähtajaklass 2:** 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta **Tähtajaklass 3:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat **Tähtajaklass 4:** 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 5 aastat **Tähtajaklass 5:** 5 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 10 aastat **Tähtajaklass 6:** üle 10 aasta			

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
Mitmes valuutas või erinevates valuutades fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid/optsioonid Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forvard/optsioon, mille kaks poolt vahetavad eri valuutades nomineeritud rahavooge ning ühe poole rahavood on määratud kindlaks fikseeritud intressimääraga ja teise poole rahavood ujuva intressimääraga. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS RTS2#16 = XFMC	Mitmes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#13 ja RTS23#42) – tinglike valuutade paar, mis on määratletud kui kahe sellise valuuta kombinatsioon, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta Tähtajaklass 5: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat Tähtajaklass 6: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	50 000 000 eurot	10	

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
Mitmes valuutas või erinevates valuutades ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid/optsioonid Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forvard/optsioon, mille kaks poolt vahetavad eri valuutades nomineeritud rahavooge ja mõlema poole rahavood on määratud kindlaks ujuva intressimääraga RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS RTS2#16 = FFMC	Mitmes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#13 ja RTS23#42) – tinglike valuutade paar, mis on määratletud kui kahe sellise valuuta kombinatsioon, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta Tähtajaklass 5: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat Tähtajaklass 6: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	50 000 000 eurot	10	

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
Mitmes valuutas või erinevates valuutades fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid/optsioonid Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forvard/optsioon, mille kaks poolt vahetavad eri valuutades nomineeritud rahavooge ja mõlema poole rahavood on määratud kindlaks fikseeritud intressimääraga RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS RTS2#16 = XXMC	Mitmes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#13 ja RTS23#42) – tinglike valuutade paar, mis on määratletud kui kahe sellise valuuta kombinatsioon, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta Tähtajaklass 5: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat Tähtajaklass 6: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	50 000 000 eurot	10	

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
Mitmes valuutas või erinevates valuutades üleöö intressimäära vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades üleöö intressimäära vahetustehingute futuurid/forvardid/optsioonid Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forvard/optsioon, mille kaks poolt vahetavad eri valuutades nomineeritud rahavooge ja vähemalt ühe poole rahavood on määratud kindlaks üleöö intressimäära vahetustehingu intressimääraga RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS RTS2#16 = OSMC	Mitmes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#13 ja RTS23#42) – tinglike valuutade paar, mis on määratletud kui kahe sellise valuuta kombinatsioon, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta Tähtajaklass 5: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat Tähtajaklass 6: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	50 000 000 eurot	10	

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
Mitmes valuutas või erinevates valuutades inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forvardid/optsioonid Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forvard/optsioon, mille kaks poolt vahetavad eri valuutades nomineeritud rahavooge ja vähemalt ühe poole rahavood on määratud kindlaks inflatsioonimääraga **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS RTS2#16 = IFMC	Mitmes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#13 ja RTS23#42) – tinglike valuutade paar, mis on määratletud kui kahe sellise valuuta kombinatsioon, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta Tähtajaklass 5: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat Tähtajaklass 6: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	50 000 000 eurot	10	

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
Ühes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud ja ühes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid/optsioonid Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forvard/optsioon, mille kaks poolt vahetavad samas valuutas nomineeritud rahavooge ning ühe poole rahavood on määratud kindlaks fikseeritud intressimääraga ja teise poole rahavood ujuva intressimääraga **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS RTS2#16 = XFSC	Ühes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#13) – tinglik valuuta, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta Tähtajaklass 5: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat Tähtajaklass 6: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	50 000 000 eurot	10	

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
Ühes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud ja ühes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid/optsioonid Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forvard/optsioon, mille kaks poolt vahetavad samas valuutas nomineeritud rahavooge ja mõlema poole rahavood on määratud kindlaks ujuva intressimääraga RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS RTS2#16 = FFSC	Ühes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#13) – tinglik valuuta, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta Tähtajaklass 5: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat Tähtajaklass 6: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	50 000 000 eurot	10	

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
Ühes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingud ja ühes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid/optsioonid Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forvard/optsioon, mille kaks poolt vahetavad samas valuutas nomineeritud rahavooge ja mõlema poole rahavood on määratud kindlaks fikseeritud intressimääraga RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS RTS2#16 = XXSC	Ühes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#13) – tinglik valuuta, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta Tähtajaklass 5: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat Tähtajaklass 6: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	50 000 000 eurot	10	

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
Ühes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingud ja ühes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingute futuurid/forvardid/optsioonid Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forvard/optsioon, mille kaks poolt vahetavad samas valuutas nomineeritud rahavooge ja vähemalt ühe poole rahavood on määratud kindlaks üleöö intressimäära vahetustehingu intressimääraga **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS RTS2#16 = OSSC	Ühes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#13) – tinglik valuuta, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta Tähtajaklass 5: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat Tähtajaklass 6: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	50 000 000 eurot	10	

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium**
Ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingud ja ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forvardid/optsioonid Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forvard/optsioon, mille kaks poolt vahetavad samas valuutas nomineeritud rahavooge ja vähemalt ühe poole rahavood on määratud kindlaks inflatsioonimääraga **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS RTS2#16 = IFSC	Ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#13) – tinglik valuuta, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta Tähtajaklass 5: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat Tähtajaklass 6: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	50 000 000 eurot	10	

▼M3

Varaklass – intressimäära tuletisinstrumendid	
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kasutatakse järgmist metoodikat**
Muud intressimäära tuletisinstrumendid Intressimäära tuletisinstrument, mis ei kuulu ühessegi ülalnimetatud varade alamklassi **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = OTHR	Mis tahes muud intressimäära tuletisinstrumenti käsitatakse likviidset turgu mitteomavana

▼M4

Tabel 5.2

Intressimäära tuletisinstrumendid – kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille kohta on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg

Varaklass – intressimäära tuletisinstrumendid									
Varade alamklass	**Kauplemiseelsete ja -järgsete künniste arvutamisel kohaldatavad protsentiilid ja alumised künnisväärtused instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul iga alamklassi korral, mille kohta on määratud kindlaks, et sellel on likviidne turg**								
	Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse	**Suur maht, kauplemiseelne**		**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**			**Suur maht, kauplemisjärgne**		
		Tehingud – protsentiil	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**
Võlakirjafutuurid/-forvardid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	5 000 000 eurot	80	60	20 000 000 eurot	90	70	25 000 000 eurot
Võlakirjaoptsioonid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	5 000 000 eurot	80	60	20 000 000 eurot	90	70	25 000 000 eurot
Intressimäärafutuurid ja intressiforvardid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	10 000 000 eurot	80	60	20 000 000 eurot	90	70	25 000 000 eurot

▼M4

Varaklass – intressimäära tuletisinstrumendid									
Varade alamklass	**Kauplemiseelsete ja -järgsete künniste arvutamisel kohaldatavad protsentiilid ja alumised künnisväärtused instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul iga alamklassi korral, mille kohta on määratud kindlaks, et sellel on likviidne turg**								
	Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse	**Suur maht, kauplemiseelne**		**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**			**Suur maht, kauplemisjärgne**		
		Tehingud – protsentiil	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**
Intressimääraoptsioonid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	10 000 000 eurot	80	60	20 000 000 eurot	90	70	25 000 000 eurot
Vahetusoptsioonid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	5 000 000 eurot	80	60	9 000 000 eurot	90	70	10 000 000 eurot
Mitmes valuutas või erinevates valuutades fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	5 000 000 eurot	80	60	9 000 000 eurot	90	70	10 000 000 eurot

▼M4

Varaklass – intressimäära tuletisinstrumendid									
Varade alamklass	**Kauplemiseelsete ja -järgsete künniste arvutamisel kohaldatavad protsentiilid ja alumised künnisväärtused instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul iga alamklassi korral, mille kohta on määratud kindlaks, et sellel on likviidne turg**								
	Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse	**Suur maht, kauplemiseelne**		**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**			**Suur maht, kauplemisjärgne**		
		Tehingud – protsentiil	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**
Mitmes valuutas või erinevates valuutades ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	5 000 000 eurot	80	60	9 000 000 eurot	90	70	10 000 000 eurot
Mitmes valuutas või erinevates valuutades fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	5 000 000 eurot	80	60	9 000 000 eurot	90	70	10 000 000 eurot

▼M4

Varaklass – intressimäära tuletisinstrumendid									
Varade alamklass	**Kauplemiseelsete ja -järgsete künniste arvutamisel kohaldatavad protsentiilid ja alumised künnisväärtused instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul iga alamklassi korral, mille kohta on määratud kindlaks, et sellel on likviidne turg**								
	Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse	**Suur maht, kauplemiseelne**		**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**			**Suur maht, kauplemisjärgne**		
		Tehingud – protsentiil	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**
Mitmes valuutas või erinevates valuutades üleöö intressimäära vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades üleöö intressimäära vahetustehingute futuurid/forvardid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	5 000 000 eurot	80	60	9 000 000 eurot	90	70	10 000 000 eurot
Mitmes valuutas või erinevates valuutades inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forvardid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	5 000 000 eurot	80	60	9 000 000 eurot	90	70	10 000 000 eurot
Ühes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud ja ühes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	5 000 000 eurot	80	60	9 000 000 eurot	90	70	10 000 000 eurot

▼M4

Varaklass – intressimäära tuletisinstrumendid									
Varade alamklass	**Kauplemiseelsete ja -järgsete künniste arvutamisel kohaldatavad protsentiilid ja alumised künnisväärtused instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul iga alamklassi korral, mille kohta on määratud kindlaks, et sellel on likviidne turg**								
	Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse	**Suur maht, kauplemiseelne**		**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**			**Suur maht, kauplemisjärgne**		
		Tehingud – protsentiil	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**
Ühes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud ja ühes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	5 000 000 eurot	80	60	9 000 000 eurot	90	70	10 000 000 eurot
Ühes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingud ja ühes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	5 000 000 eurot	80	60	9 000 000 eurot	90	70	10 000 000 eurot
Ühes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingud ja ühes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingute futuurid/forvardid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	5 000 000 eurot	80	60	9 000 000 eurot	90	70	10 000 000 eurot

▼M4

Varaklass – intressimäära tuletisinstrumendid									
Varade alamklass	**Kauplemiseelsete ja -järgsete künniste arvutamisel kohaldatavad protsentiilid ja alumised künnisväärtused instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul iga alamklassi korral, mille kohta on määratud kindlaks, et sellel on likviidne turg**								
	Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse	**Suur maht, kauplemiseelne**		**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**			**Suur maht, kauplemisjärgne**		
		Tehingud – protsentiil	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**
Ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingud ja ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forvardid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	5 000 000 eurot	80	60	9 000 000 eurot	90	70	10 000 000 eurot

Tabel 5.3

Intressimäära tuletisinstrumendid – kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille kohta on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu

Varaklass – intressimäära tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul iga alamklassi korral, mille kohta on määratud kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu**		
	Suur maht, kauplemiseelne	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
	Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Võlakirjafutuurid/-forvardid	5 000 000 eurot	20 000 000 eurot	25 000 000 eurot
Võlakirjaoptsioonid	5 000 000 eurot	20 000 000 eurot	25 000 000 eurot
Intressimäärafutuurid ja intressiforvardid	10 000 000 eurot	20 000 000 eurot	25 000 000 eurot

▼M4

Varaklass – intressimäära tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul iga alamklassi korral, mille kohta on määratud kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu**		
	Suur maht, kauplemiseelne	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
	Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Intressimääraoptsioonid	10 000 000 eurot	20 000 000 eurot	25 000 000 eurot
Vahetusoptsioonid	5 000 000 eurot	9 000 000 eurot	10 000 000 eurot
Mitmes valuutas või erinevates valuutades fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid	5 000 000 eurot	9 000 000 eurot	10 000 000 eurot
Mitmes valuutas või erinevates valuutades ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid	5 000 000 eurot	9 000 000 eurot	10 000 000 eurot
Mitmes valuutas või erinevates valuutades fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid	5 000 000 eurot	9 000 000 eurot	10 000 000 eurot
Mitmes valuutas või erinevates valuutades üleöö intressimäära vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades üleöö intressimäära vahetustehingute futuurid/forvardid	5 000 000 eurot	9 000 000 eurot	10 000 000 eurot
Mitmes valuutas või erinevates valuutades inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forvardid	5 000 000 eurot	9 000 000 eurot	10 000 000 eurot
Ühes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud ja ühes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid	5 000 000 eurot	9 000 000 eurot	10 000 000 eurot

▼M4

Varaklass – intressimäära tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul iga alamklassi korral, mille kohta on määratud kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu**		
	Suur maht, kauplemiseelne	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
	Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Ühes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud ja ühes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid	5 000 000 eurot	9 000 000 eurot	10 000 000 eurot
Ühes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingud ja ühes valuutas fikseeritud--määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid	5 000 000 eurot	9 000 000 eurot	10 000 000 eurot
Ühes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingud ja ühes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingute futuurid/forvardid	5 000 000 eurot	9 000 000 eurot	10 000 000 eurot
Ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingud ja ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forvardid	5 000 000 eurot	9 000 000 eurot	10 000 000 eurot
Muud intressimäära tuletisinstrumendid	5 000 000 eurot	9 000 000 eurot	10 000 000 eurot

▼B

6. **Aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid**

▼M3

Tabel 6.1

Aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid – klassid, millel ei ole likviidset turgu

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid
Mis tahes leping, mis on määratletud direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktis 4 ja mis on seotud: a) ühe või mitme aktsiaga, hoidmistunnistustega, börsil kaubeldavate fondidega, sertifikaatidega, muude sarnaste finantsinstrumentidega, rahavoogudega või muude toodetega, mis on seotud ühe või mitme aktsia, hoidmistunnistuste, börsil kaubeldavate fondide, sertifikaatide või muude sarnaste finantsinstrumentide tootlusega; b) aktsiate, hoidmistunnistuste, börsil kaubeldavate fondide, sertifikaatide, muude sarnaste finantsinstrumentide, rahavoogude või muude selliste toodete indeksiga, mis on seotud ühe või mitme aktsia, hoidmistunnistuste, börsil kaubeldavate fondide, sertifikaatide või muude sarnaste finantsinstrumentide tootlusega.

▼M3

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid	
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat**
Aktsiaindeksioptsioonid Optsioon, mille aluseks on aktsiatest koosnev indeks RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = STIX RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28	Kõiki indeksioptsioone käsitatakse likviidset turgu omavana
Aktsiaindeksifutuurid/-forvardid Futuur/forvard, mille aluseks on aktsiatest koosnev indeks RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = FUTR või FORW RTS2#27 = STIX RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28	Kõiki indeksifutuure/-forvardeid käsitatakse likviidset turgu omavana
Aktsiaoptsioonid Optsioon, mille aluseks on aktsia või aktsiakorv, mis tuleneb korporatiivsest sündmusest RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = SHRS RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28	Kõiki aktsiaoptsioone käsitatakse likviidset turgu omavana

▼M3

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid	
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat**
Aktsiafutuurid/-forvardid Futuur/forvard, mille aluseks on aktsia või aktsiakorv, mis tuleneb korporatiivsest sündmusest RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI’ RTS2#5 = FUTR või FORW RTS2#27 = SHRS RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28	Kõiki aktsiafutuure/-forvardeid käsitatakse likviidset turgu omavana
Aktsiadividendioptsioonid Teatava aktsia dividendi optsioon RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI’ RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = DVSE RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28	Kõiki aktsiadividendioptsioone käsitatakse likviidset turgu omavana
Aktsiadividendifutuurid/-forvardid Teatava aktsia dividendi futuur/forvard RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI’ RTS2#5 = FUTR või FORW RTS2#27 = DVSE RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28	Kõiki aktsiadividendifutuure/-forvardeid käsitatakse likviidset turgu omavana

▼M3

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid	
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat**
Dividendiindeksioptsioonid Rohkem kui ühe aktsia dividendidest koosneva indeksi optsioon RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = DIVI RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28	Kõiki dividendiindeksioptsioone käsitatakse likviidset turgu omavana
Dividendiindeksifutuurid/-forvardid Rohkem kui ühe aktsia dividendidest koosneva indeksi futuur/forvard RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = FUTR või FORW RTS2#27 = DIVI RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28	Kõiki dividendiindeksifutuure/-forvardeid käsitatakse likviidset turgu omavana
Volatiilsusindeksioptsioonid Optsioon, mille aluseks on volatiilsusindeks, mis on määratletud kui teatava aluseks oleva kapitaliinstrumentide indeksiga seotud volatiilsuse indeks RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = VOLI RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28	Kõiki volatiilsusindeksioptsioone käsitatakse likviidset turgu omavana

▼M3

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid	
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat**
Volatiilsusindeksifutuurid/-forvardid Futuur/forvard, mille aluseks on volatiilsusindeks, mis on määratletud kui teatava aluseks oleva kapitaliinstrumentide indeksiga seotud volatiilsuse indeks RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = FUTR või FORW RTS2#27 = VOLI RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28	Kõiki volatiilsusindeksifutuure/-forvardeid käsitatakse likviidset turgu omavana
Börsil kaubeldavate fondide optsioonid Optsioon, mille alusvara on börsil kaubeldav fond RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = ETFS RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28	Kõiki börsil kaubeldavate fondide optsioone käsitatakse likviidset turgu omavana
Börsil kaubeldavate fondide futuurid/forvardid Futuur/forvard, mille alusvara on börsil kaubeldav fond RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = FUTR või FORW RTS2#27 = ETFS RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28	Kõiki börsil kaubeldavate fondide futuure/forvardeid käsitatakse likviidset turgu omavana

▼M3

<table>
<tr><td colspan="4">Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Varade alamklass</td><td rowspan="2">Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana vastavalt artikkile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud</td><td colspan="2">allpool</td></tr>
<tr><td>Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artikkile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]</td><td>Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]</td></tr>
<tr><td>Vahetustehingud
RTS2#3 = DERV
RTS2#4 = EQUI’
RTS2#5 = SWAP</td><td>Vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi:
Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS2#27) – alusvara liik: üks alusvara, indeks, korv
Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28) – aluseks on üks alusvara, indeks, korv
Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#28) – parameeter: hinna ja tulususe näitaja põhiparameeter (price return basic performance parameter), dividendi tulususe parameeter (parameter return dividend), tulususe variatsiooni parameeter (parameter return variance), tulususe volatiilsuse parameeter (parameter return volatility)
Segmenteerimiskriteerium 4 (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:
<table>
<tr><td>Hinna ja tulususe näitaja põhiparameeter (price return basic performance parameter)</td><td>Tulususe variatsiooni/volatiilsuse parameeter (parameter return variance/volatility)</td><td>Dividendi tulususe parameeter (parameter return dividend)</td></tr>
<tr><td>Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu</td><td>Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud</td><td>Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td></tr>
<tr><td>Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud</td><td>Tähtajaklass 2: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud</td><td>Tähtajaklass 2: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</td></tr>
<tr><td>Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud</td><td>Tähtajaklass 3: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td><td>Tähtajaklass 3: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat</td></tr>
<tr><td>Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td><td>Tähtajaklass 4: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</td><td>…</td></tr>
</table></td><td>50 000 000 eurot</td><td></td></tr>
</table>

▼M3

<table>
<tr><td colspan="5">Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Varade alamklass</td><td colspan="3" rowspan="2">Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana vastavalt artikkile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud</td><td colspan="2">allpool</td></tr>
<tr><td>Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artikkile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest
Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]</td><td>Keskmine päevane tehingute arv
[kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]</td></tr>
<tr><td rowspan="4"></td><td>Tähtajaklass 5: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</td><td>Tähtajaklass 5: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat</td><td>Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat</td><td rowspan="4"></td><td rowspan="4"></td></tr>
<tr><td>Tähtajaklass 6: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat</td><td>…</td><td></td></tr>
<tr><td>…</td><td>Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat</td><td></td></tr>
<tr><td>Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>Portfellivahetustehingud
RTS2#3 = DERV
RTS2#4 = EQUI’
RTS2#5 = PSWP</td><td colspan="3">Portfellivahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmise spetsiifilise kombinatsiooni alusel.
Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS2#27) – alusvara liik: üks alusvara, indeks, korv
Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28) – aluseks on üks alusvara, indeks, korv
Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#28) – parameeter: hinna ja tulususe näitaja põhiparameeter (price return basic performance parameter), dividendi tulususe parameeter (parameter return dividend), tulususe variatsiooni parameeter (parameter return variance), tulususe volatiilsuse parameeter (parameter return volatility)
Segmenteerimiskriteerium 4 (RTS2#8) – portfellivahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:
Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu
Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud
Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud
Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta
Tähtajaklass 5: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat
Tähtajaklass 6: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat
…
Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat</td><td>50 000 000 eurot</td><td>15</td></tr>
</table>

▼M3

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid	
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kasutatakse järgmist metoodikat**
Muud aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid – aktsiatel põhinev tuletisinstrument, mis ei kuulu ühessegi ülalnimetatud varade alamklassi RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OTHR’	Mis tahes muud aktsiatel põhinevat tuletisinstrumenti käsitatakse likviidset turgu mitteomavana

▼M4

Tabel 6.2

Aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid – kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille kohta on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid						
Varade alamklass	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsete ja -järgsete künniste kindlaksmääramiseks segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse**	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsed ja -järgsed künnisväärtused, mis on määratud alamklassidele, mille puhul on sellise keskmise päevase tingliku väärtuse vahemiku põhjal, kuhu alamklass kuulub, kindlaks määratud, et neil on likviidne turg**			
			Keskmine päevane tinglik väärtus	**Suur maht, kauplemiseelne**	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
				Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Aktsiaindeksioptsioonid	Aktsiaindeksioptsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** – aluseks olev aktsiaindeks	Künnised tuleks arvutada iga alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	Keskmine päevane tinglik väärtus < 100 miljonit eurot	25 000 eurot	1 000 000 eurot	1 500 000 eurot
			100 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 200 miljonit eurot	3 000 000 eurot	25 000 000 eurot	30 000 000 eurot
			200 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 600 miljonit eurot	5 500 000 eurot	50 000 000 eurot	55 000 000 eurot
			Keskmine päevane tinglik väärtus ≥ 600 miljonit eurot	20 000 000 eurot	150 000 000 eurot	160 000 000 eurot

▼M4

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid						
Varade alamklass	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsete ja -järgsete künniste kindlaksmääramiseks segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse**	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsed ja -järgsed künnisväärtused, mis on määratud alamklassidele, mille puhul on sellise keskmise päevase tingliku väärtuse vahemiku põhjal, kuhu alamklass kuulub, kindlaks määratud, et neil on likviidne turg**			
			Keskmine päevane tinglik väärtus	**Suur maht, kauplemiseelne**	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
				Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Aktsiaindeksifutuurid/-forvardid	Aktsiaindeksifutuuri/-forvardi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** – aluseks olev aktsiaindeks	Künnised tuleks arvutada iga alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	Keskmine päevane tinglik väärtus < 100 miljonit eurot	25 000 eurot	1 000 000 eurot	1 500 000 eurot
			100 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 1 miljard eurot	550 000 eurot	5 000 000 eurot	5 500 000 eurot
			1 miljard eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 3 miljardit eurot	5 500 000 eurot	50 000 000 eurot	55 000 000 eurot
			3 miljardit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 5 miljardit eurot	20 000 000 eurot	150 000 000 eurot	160 000 000 eurot
			Keskmine päevane tinglik väärtus ≥ 5 miljardit eurot	30 000 000 eurot	250 000 000 eurot	260 000 000 eurot
Aktsiaoptsioonid	Aktsiaoptsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** – alusvaraks olev aktsia	Künnised tuleks arvutada iga alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	Keskmine päevane tinglik väärtus < 5 miljonit eurot	25 000 eurot	1 000 000 eurot	1 250 000 eurot
			5 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 10 miljonit eurot	300 000 eurot	1 250 000 eurot	1 500 000 eurot
			10 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 20 miljonit eurot	550 000 eurot	2 500 000 eurot	3 000 000 eurot
			Keskmine päevane tinglik väärtus ≥ 20 miljonit eurot	1 500 000 eurot	5 000 000 eurot	5 500 000 eurot

▼M4

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid						
Varade alamklass	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsete ja -järgsete künniste kindlaksmääramiseks segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse**	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsed ja -järgsed künnisväärtused, mis on määratud alamklassidele, mille puhul on sellise keskmise päevase tingliku väärtuse vahemiku põhjal, kuhu alamklass kuulub, kindlaks määratud, et neil on likviidne turg**			
			Keskmine päevane tinglik väärtus	**Suur maht, kauplemiseelne**	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
				Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Aktsiafutuurid/-forvardid	Aktsiafutuuri/-forvardi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** – alusvaraks olev aktsia	Künnised tuleks arvutada iga alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	Keskmine päevane tinglik väärtus < 5 miljonit eurot	25 000 eurot	1 000 000 eurot	1 250 000 eurot
			5 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 10 miljonit eurot	300 000 eurot	1 250 000 eurot	1 500 000 eurot
			10 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 20 miljonit eurot	550 000 eurot	2 500 000 eurot	3 000 000 eurot
			Keskmine päevane tinglik väärtus ≥ 20 miljonit eurot	1 500 000 eurot	5 000 000 eurot	5 500 000 eurot
Aktsiadividendioptsioonid	Aktsiadividendioptsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** – alusvaraks olev aktsia, mis annab õiguse dividendidele	Künnised tuleks arvutada iga alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	Keskmine päevane tinglik väärtus < 5 miljonit eurot	25 000 eurot	400 000 eurot	450 000 eurot
			5 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 10 miljonit eurot	30 000 eurot	500 000 eurot	550 000 eurot
			10 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 20 miljonit eurot	100 000 eurot	1 000 000 eurot	1 500 000 eurot
			Keskmine päevane tinglik väärtus ≥ 20 miljonit eurot	150 000 eurot	2 000 000 eurot	2 500 000 eurot

▼M4

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid						
Varade alamklass	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsete ja -järgsete künniste kindlaksmääramiseks segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse**	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsed ja -järgsed künnisväärtused, mis on määratud alamklassidele, mille puhul on sellise keskmise päevase tingliku väärtuse vahemiku põhjal, kuhu alamklass kuulub, kindlaks määratud, et neil on likviidne turg**			
			Keskmine päevane tinglik väärtus	**Suur maht, kauplemiseelne**	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
				Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Aktsiadividendifutuurid/-forvardid	Aktsiadividendifutuuri/-forvardi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** – alusvaraks olev aktsia, mis annab õiguse dividendidele	Künnised tuleks arvutada iga alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	Keskmine päevane tinglik väärtus < 5 miljonit eurot	25 000 eurot	400 000 eurot	450 000 eurot
			5 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 10 miljonit eurot	30 000 eurot	500 000 eurot	550 000 eurot
			10 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 20 miljonit eurot	100 000 eurot	1 000 000 eurot	1 500 000 eurot
			Keskmine päevane tinglik väärtus ≥ 20 miljonit eurot	150 000 eurot	2 000 000 eurot	2 500 000 eurot
Dividendiindeksioptsioonid	Dividendiindeksioptsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** – aluseks olev dividendiindeks	Künnised tuleks arvutada iga alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	Keskmine päevane tinglik väärtus < 100 miljonit eurot	25 000 eurot	1 000 000 eurot	1 500 000 eurot
			100 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 200 miljonit eurot	3 000 000 eurot	25 000 000 eurot	30 000 000 eurot
			200 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 600 miljonit eurot	5 500 000 eurot	50 000 000 eurot	55 000 000 eurot
			Keskmine päevane tinglik väärtus ≥ 600 miljonit eurot	20 000 000 eurot	150 000 000 eurot	160 000 000 eurot

▼M4

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid						
Varade alamklass	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsete ja -järgsete künniste kindlaksmääramiseks segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse**	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsed ja -järgsed künnisväärtused, mis on määratud alamklassidele, mille puhul on sellise keskmise päevase tingliku väärtuse vahemiku põhjal, kuhu alamklass kuulub, kindlaks määratud, et neil on likviidne turg**			
			Keskmine päevane tinglik väärtus	**Suur maht, kauplemiseelne**	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
				Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Dividendiindeksi-futuurid/-forvardid	Dividendiindeksifutuuri/-forvardi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** – aluseks olev dividendiindeks	Künnised tuleks arvutada iga alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	Keskmine päevane tinglik väärtus < 100 miljonit eurot	25 000 eurot	1 000 000 eurot	1 500 000 eurot
			100 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 1 miljard eurot	550 000 eurot	5 000 000 eurot	5 500 000 eurot
			1 miljard eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 3 miljardit eurot	5 500 000 eurot	50 000 000 eurot	55 000 000 eurot
			3 miljardit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 5 miljardit eurot	20 000 000 eurot	150 000 000 eurot	160 000 000 eurot
			Keskmine päevane tinglik väärtus ≥ 5 miljardit eurot	30 000 000 eurot	250 000 000 eurot	260 000 000 eurot
Volatiilsusindeksi-optsioonid	Volatiilsusindeksioptsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** – aluseks olev volatiilsusindeks	Künnised tuleks arvutada iga alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	Keskmine päevane tinglik väärtus < 100 miljonit eurot	25 000 eurot	1 000 000 eurot	1 500 000 eurot
			100 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 200 miljonit eurot	3 000 000 eurot	25 000 000 eurot	30 000 000 eurot
			200 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 600 miljonit eurot	5 500 000 eurot	50 000 000 eurot	55 000 000 eurot
			Keskmine päevane tinglik väärtus ≥ 600 miljonit eurot	20 000 000 eurot	150 000 000 eurot	160 000 000 eurot

▼M4

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid						
Varade alamklass	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsete ja -järgsete künniste kindlaksmääramiseks segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse**	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsed ja -järgsed künnisväärtused, mis on määratud alamklassidele, mille puhul on sellise keskmise päevase tingliku väärtuse vahemiku põhjal, kuhu alamklass kuulub, kindlaks määratud, et neil on likviidne turg**			
			Keskmine päevane tinglik väärtus	**Suur maht, kauplemiseelne**	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
				Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Volatiilsusindeksi-futuurid/-forvardid	Volatiilsusindeksifutuuri/-forvardi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** – aluseks olev volatiilsusindeks	Künnised tuleks arvutada iga alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	Keskmine päevane tinglik väärtus < 100 miljonit eurot	25 000 eurot	1 000 000 eurot	1 500 000 eurot
			100 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 1 miljard eurot	550 000 eurot	5 000 000 eurot	5 500 000 eurot
			1 miljard eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 3 miljardit eurot	5 500 000 eurot	50 000 000 eurot	55 000 000 eurot
			3 miljardit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 5 miljardit eurot	20 000 000 eurot	150 000 000 eurot	160 000 000 eurot
			Keskmine päevane tinglik väärtus ≥ 5 miljardit eurot	30 000 000 eurot	250 000 000 eurot	260 000 000 eurot
Börsil kaubeldavate fondide optsioonid	Börsil kaubeldavate fondide optsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** – alusvaraks olev börsil kaubeldav fond	Künnised tuleks arvutada iga alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	Keskmine päevane tinglik väärtus < 5 miljonit eurot	25 000 eurot	1 000 000 eurot	1 250 000 eurot
			5 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 10 miljonit eurot	300 000 eurot	1 250 000 eurot	1 500 000 eurot
			10 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 20 miljonit eurot	550 000 eurot	2 500 000 eurot	3 000 000 eurot
			Keskmine päevane tinglik väärtus ≥ 20 miljonit eurot	1 500 000 eurot	5 000 000 eurot	5 500 000 eurot

▼M4

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid						
Varade alamklass	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsete ja -järgsete künniste kindlaksmääramiseks segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse**	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsed ja -järgsed künnisväärtused, mis on määratud alamklassidele, mille puhul on sellise keskmise päevase tingliku väärtuse vahemiku põhjal, kuhu alamklass kuulub, kindlaks määratud, et neil on likviidne turg**			
			Keskmine päevane tinglik väärtus	**Suur maht, kauplemiseelne**	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
				Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Börsil kaubeldavate fondide futuurid/forvardid	Börsil kaubeldavate fondide futuuri/forvardi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** – alusvaraks olev börsil kaubeldav fond	Künnised tuleks arvutada iga alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	Keskmine päevane tinglik väärtus < 5 miljonit eurot	25 000 eurot	1 000 000 eurot	1 250 000 eurot
			5 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 10 miljonit eurot	300 000 eurot	1 250 000 eurot	1 500 000 eurot
			10 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 20 miljonit eurot	550 000 eurot	2 500 000 eurot	3 000 000 eurot
			Keskmine päevane tinglik väärtus ≥ 20 miljonit eurot	1 500 000 eurot	5 000 000 eurot	5 500 000 eurot
Vahetustehingud	Vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi: **Segmenteerimiskriteerium 1** – alusvara liik: üks alusvara, indeks, korv **Segmenteerimiskriteerium 2** – aluseks on üks alusvara, indeks, korv **Segmenteerimiskriteerium 3** – parameeter: hinna ja tulususe näitaja põhiparameeter (*price return basic performance parameter*), dividendi tulususe parameeter (*parameter return dividend*), tulususe variatsiooni parameeter (*parameter return variance*), tulususe volatiilsuse parameeter (*parameter return volatility*) **Segmenteerimiskriteerium 4** – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:	Künnised tuleks arvutada iga alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	50 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 100 miljonit eurot	300 000 eurot	1 250 000 eurot	1 500 000 eurot
			100 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 200 miljonit eurot	550 000 eurot	2 500 000 eurot	3 000 000 eurot
			Keskmine päevane tinglik väärtus ≥ 200 miljonit eurot	1 500 000 eurot	5 000 000 eurot	5 500 000 eurot

▼M4

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid								
Varade alamklass	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsete ja -järgsete künniste kindlaksmääramiseks segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**			**Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse**	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsed ja -järgsed künnisväärtused, mis on määratud alamklassidele, mille puhul on sellise keskmise päevase tingliku väärtuse vahemiku põhjal, kuhu alamklass kuulub, kindlaks määratud, et neil on likviidne turg**			
					Keskmine päevane tinglik väärtus	**Suur maht, kauplemiseelne**	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
						Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
	Hinna ja tulususe näitaja põhiparameeter (*price return basic performance parameter*)	Tulususe variatsiooni/volatiilsuse parameeter (*parameter return variance/volatility*)	Dividendi tulususe parameeter (*parameter return dividend*)					
	Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu	Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud	Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta					
	Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud	Tähtajaklass 2: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud	Tähtajaklass 2: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat					
	Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud	Tähtajaklass 3: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta	Tähtajaklass 3: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat					
	Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta	Tähtajaklass 4: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat	…					

▼M4

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid								
Varade alamklass	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsete ja -järgsete künniste kindlaksmääramiseks segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**			**Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse**	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsed ja -järgsed künnisväärtused, mis on määratud alamklassidele, mille puhul on sellise keskmise päevase tingliku väärtuse vahemiku põhjal, kuhu alamklass kuulub, kindlaks määratud, et neil on likviidne turg**			
					Keskmine päevane tinglik väärtus	**Suur maht, kauplemiseelne**	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
						Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
	Tähtajaklass 5: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat	Tähtajaklass 5: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat	Tähtajaklass *m*: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ *n* aastat					
	Tähtajaklass 6: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat	…						
	…	Tähtajaklass *m*: (*n* – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ *n* aastat						
	Tähtajaklass *m*: (*n* – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ *n* aastat							
Portfellivahetustehingud	Portfellivahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmise spetsiifilise kombinatsiooni alusel. **Segmenteerimiskriteerium 1** – alusvara liik: üks alusvara, indeks, korv **Segmenteerimiskriteerium 2** – aluseks on üks alusvara, indeks, korv **Segmenteerimiskriteerium 3** – parameeter: hinna ja tulususe näitaja põhiparameeter (*price return basic performance parameter*), dividendi tulususe parameeter (*parameter return dividend*), tulususe variatsiooni parameeter (*parameter return variance*), tulususe volatiilsuse parameeter (*parameter return volatility*) **Segmenteerimiskriteerium 4** – portfellivahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt.			Künnised tuleks arvutada iga alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	50 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 100 miljonit eurot	300 000 eurot	1 250 000 eurot	1 500 000 eurot
					100 miljonit eurot ≤ keskmine päevane tinglik väärtus < 200 miljonit eurot	550 000 eurot	2 500 000 eurot	3 000 000 eurot
					Keskmine päevane tinglik väärtus ≥ 200 miljonit eurot	1 500 000 eurot	5 000 000 eurot	5 500 000 eurot

▼M4

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid						
Varade alamklass	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsete ja -järgsete künniste kindlaksmääramiseks segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse**	**Instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul kauplemiseelsed ja -järgsed künnisväärtused, mis on määratud alamklassidele, mille puhul on sellise keskmise päevase tingliku väärtuse vahemiku põhjal, kuhu alamklass kuulub, kindlaks määratud, et neil on likviidne turg**			
			Keskmine päevane tinglik väärtus	**Suur maht, kauplemiseelne**	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
				Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
	Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta Tähtajaklass 5: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat Tähtajaklass 6: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … Tähtajaklass *m*: (*n* – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ *n* aastat					

Tabel 6.3

Aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid – kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille kohta on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu**		
	Suur maht, kauplemiseelne	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
	Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Vahetustehingud	25 000 eurot	100 000 eurot	150 000 eurot
Portfellivahetustehingud	25 000 eurot	100 000 eurot	150 000 eurot
Muud aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid	25 000 eurot	100 000 eurot	150 000 eurot

▼B

7. **Kauba tuletisinstrumendid**

▼M3

Tabel 7.1

Kauba tuletisinstrumendid – klassid, millel ei ole likviidset turgu

<table>
<tr><td colspan="4">Varaklass – kauba tuletisinstrumendid</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Varade alamklass</td><td rowspan="2" colspan="2">Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool</td><td colspan="2">Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest</td></tr>
<tr><td>Keskmine päevane tinglik väärtus
[kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]</td><td>Keskmine päevane tehingute arv
[kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]</td></tr>
<tr><td>Metallide kaubafutuurid/-forvardid
RTS2#3 = „DERV” ja RTS2#4 = „COMM” ning RTS23#35 = „METL” ja [RTS2#5 = „FUTR” või „FORW”]</td><td colspan="2">Metalli kaubafutuuri/-forvardi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.
Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#36) – metalli liik: väärismetall, mitteväärismetall
Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS23#37) – alusvaraks olev metall
Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#15) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles futuuri/forvardi tinglik väärtus on nomineeritud
Segmenteerimiskriteerium 4 (RTS2#8) – futuuri/forvardi järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</td><td>10 000 000 eurot</td><td>10</td></tr>
<tr><td></td><td>Väärismetallid</td><td>Mitteväärismetallid</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Tähtajaklass 1:
0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud</td><td>Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Tähtajaklass 2: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td><td>Tähtajaklass 2: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Tähtajaklass 3: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</td><td>Tähtajaklass 3: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat</td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

<table>
<tr><td colspan="4">Varaklass – kauba tuletisinstrumendid</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Varade alamklass</td><td colspan="2" rowspan="2">Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool</td><td colspan="2">Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest</td></tr>
<tr><td>Keskmine päevane tinglik väärtus
[kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]</td><td>Keskmine päevane tehingute arv
[kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]</td></tr>
<tr><td></td><td>Tähtajaklass 4:
2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat</td><td>…</td><td rowspan="3"></td><td rowspan="3"></td></tr>
<tr><td></td><td>…</td><td>Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat</td></tr>
<tr><td></td><td>Tähtajaklass m:
(n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="6">Metallide kaubaoptsioonid
RTS2#3 = „DERV” ja RTS2#4 = „COMM” ning RTS23#35 = „METL” ja RTS2#5 = „OPTN”</td><td colspan="2">Metalli kaubaoptsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.
Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#36) – metalli liik: väärismetall, mitteväärismetall
Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS23#37) – alusvaraks olev metall
Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#15) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles optsiooni tinglik väärtus on nomineeritud
Segmenteerimiskriteerium 4 (RTS2#8) – optsiooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</td><td rowspan="6">10 000 000 eurot</td><td rowspan="6">10</td></tr>
<tr><td>Väärismetallid</td><td>Mitteväärismetallid</td></tr>
<tr><td>Tähtajaklass 1:
0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud</td><td>Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td></tr>
<tr><td>Tähtajaklass 2:
3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td><td>Tähtajaklass 2: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</td></tr>
<tr><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td colspan="2"></td></tr>
</table>

▼M3

<table>
<tr><td colspan="4">Varaklass – kauba tuletisinstrumendid</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Varade alamklass</td><td colspan="2" rowspan="2">Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool</td><td colspan="2">Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest</td></tr>
<tr><td>Keskmine päevane tinglik väärtus
[kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]</td><td>Keskmine päevane tehingute arv
[kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]</td></tr>
<tr><td rowspan="4"></td><td>Tähtajaklass 3:
1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</td><td>Tähtajaklass 3: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat</td><td rowspan="4"></td><td rowspan="4"></td></tr>
<tr><td>Tähtajaklass 4:
2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat</td><td>…</td></tr>
<tr><td>…</td><td>Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat</td></tr>
<tr><td>Tähtajaklass m:
(n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat</td><td></td></tr>
<tr><td>Metallide kaubavahetustehingud
RTS2#3 = „DERV” ja RTS2#4 = „COMM” ning RTS23#35 = „METL” ja RTS2#5 = „SWAP”</td><td colspan="2">Metalli kaubavahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.
Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#36) – metalli liik: väärismetall, mitteväärismetall
Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS23#37) – alusvaraks olev metall
Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#15) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles vahetustehingu tinglik väärtus on nomineeritud
Segmenteerimiskriteerium 4 (RTS23#34) – tarne liik, mis on määratletud sularahas, füüsilise või valikulisena
Segmenteerimiskriteerium 5 (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</td><td>10 000 000 eurot</td><td>10</td></tr>
<tr><td>Väärismetallid</td><td>Mitteväärismetallid</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>Tähtajaklass 1:
0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud</td><td>Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

Varaklass – kauba tuletisinstrumendid				
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**		**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest**	
			Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]
	Tähtajaklass 2: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta	**Tähtajaklass 2:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat		
	Tähtajaklass 3: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat	**Tähtajaklass 3:** 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat		
	Tähtajaklass 4: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat	…		
	…	**Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat		
	Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat			
Energia kaubafutuurid/ -forvardid RTS2#3 = „DERV” ja RTS2#4 = „COMM” ning RTS23#35 = „NRGY” ja [RTS2#5 = „FUTR” või „FORW”]	Energia kaubafutuuri/-forvardi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#36) – energialiik: nafta, nafta destillaadid, kivisüsi, kergfraktsioonid, maagaas, elekter, mitu energialiiki **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS23#37) – alusvaraks olev energia **Segmenteerimiskriteerium 3** (RTS2#15) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles futuuri/forvardi tinglik väärtus on nomineeritud **Segmenteerimiskriteerium 4** – [välja jäetud]		10 000 000 eurot	10

▼M3

<table>
<tr><td colspan="5">Varaklass – kauba tuletisinstrumendid</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Varade alamklass</td><td colspan="3" rowspan="2">Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool</td><td colspan="2">Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest</td></tr>
<tr><td>Keskmine päevane tinglik väärtus
[kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]</td><td>Keskmine päevane tehingute arv
[kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]</td></tr>
<tr><td rowspan="8"></td><td colspan="3">Segmenteerimiskriteerium 5 (RTS2#14) – tarne / rahalise arvelduse koht, mis on asjakohane kõikide energialiikide puhul
Segmenteerimiskriteerium 6 (RTS2#8) – futuuri/forvardi järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</td><td rowspan="8"></td><td rowspan="8"></td></tr>
<tr><td>Nafta/destillaadid/kergfraktsioonid</td><td>Kivisüsi</td><td>Maagaas/elekter/ mitu energialiiki</td></tr>
<tr><td>Tähtajaklass 1:
0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 4 kuud</td><td>Tähtajaklass 1:
0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud</td><td>Tähtajaklass 1:
0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu</td></tr>
<tr><td>Tähtajaklass 2:
4 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 8 kuud</td><td>Tähtajaklass 2:
6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td><td>Tähtajaklass 2:
1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td></tr>
<tr><td>Tähtajaklass 3:
8 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td><td>Tähtajaklass 3:
1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</td><td>Tähtajaklass 3:
1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</td></tr>
<tr><td>Tähtajaklass 4:
1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</td><td>…</td><td>…</td></tr>
<tr><td>…</td><td>Tähtajaklass m:
(n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat</td><td>Tähtajaklass m:
(n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat</td></tr>
<tr><td>Tähtajaklass m:
(n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat</td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

<table>
<tr><th colspan="5">Varaklass – kauba tuletisinstrumendid</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Varade alamklass</th><th colspan="3" rowspan="2">Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool</th><th colspan="2">Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest</th></tr>
<tr><th>Keskmine päevane tinglik väärtus
[kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]</th><th>Keskmine päevane tehingute arv
[kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]</th></tr>
<tr><td>Energia kaubaoptsioonid
RTS2#3 = „DERV” ja RTS2#4 = „COMM” ning RTS23#35 = „NRGY” ja RTS2#5 = „OPTN”</td><td colspan="3">Energia kaubaoptsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.
Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#36) – energialiik: nafta, nafta destillaadid, kivisüsi, kergfraktsioonid, maagaas, elekter, mitu energialiiki
Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS23#37) – alusvaraks olev energia
Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#15) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles optsiooni tinglik väärtus on nomineeritud
Segmenteerimiskriteerium 4 – [välja jäetud]
Segmenteerimiskriteerium 5 (RTS2#14) – tarne / rahalise arvelduse koht, mis on asjakohane kõikide energialiikide puhul
Segmenteerimiskriteerium 6 (RTS2#8) – optsiooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</td><td>10 000 000 eurot</td><td>10</td></tr>
<tr><td></td><td>Nafta/destillaadid/kergfraktsioonid</td><td>Kivisüsi</td><td>Maagaas/elekter/ mitu energialiiki</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Tähtajaklass 1:
0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 4 kuud</td><td>Tähtajaklass 1:
0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud</td><td>Tähtajaklass 1:
0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Tähtajaklass 2:
4 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 8 kuud</td><td>Tähtajaklass 2:
6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td><td>Tähtajaklass 2:
1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

Varaklass – kauba tuletisinstrumendid					
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**			**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest**	
				Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]
	Tähtajaklass 3: 8 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta	**Tähtajaklass 3:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat	**Tähtajaklass 3:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat		
	Tähtajaklass 4: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat	…	…		
	…	**Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	**Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat		
	Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat				
Energia kaubavahetustehingud RTS2#3 = „DERV” ja RTS2#4 = „COMM” ning RTS23#35 = „NRGY” ja RTS2#5 = „SWAP”	Energia kaubavahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#36) – energialiik: nafta, nafta destillaadid, kivisüsi, kergfraktsioonid, maagaas, elekter, mitu energialiiki **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS23#37) – alusvaraks olev energia **Segmenteerimiskriteerium 3** (RTS2#15) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles vahetustehingu tinglik väärtus on nomineeritud **Segmenteerimiskriteerium 4** (RTS23#34) – tarne liik, mis on määratletud sularahas, füüsilise või valikulisena **Segmenteerimiskriteerium 5** – [välja jäetud] **Segmenteerimiskriteerium 6** (RTS2#14) – tarne / rahalise arvelduse koht, mis on asjakohane kõikide energialiikide puhul **Segmenteerimiskriteerium 7** (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:			10 000 000 eurot	10

▼M3

Varaklass – kauba tuletisinstrumendid					
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**			**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest**	
				Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]
	Nafta/destillaadid/kergfraktsioonid	**Kivisüsi**	**Maagaas/elekter/ mitu energialiiki**		
	Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 4 kuud	**Tähtajaklass 1:** 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud	**Tähtajaklass 1:** 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu		
	Tähtajaklass 2: 4 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 8 kuud	**Tähtajaklass 2:** 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta	**Tähtajaklass 2:** 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta		
	Tähtajaklass 3: 8 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta	**Tähtajaklass 3:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat	**Tähtajaklass 3:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat		
	Tähtajaklass 4: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat	…	…		
	…	**Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	**Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat		
	Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat				
Põllumajandusliku kauba futuurid/forvardid RTS2#3 = „DERV” ja RTS2#4 = „COMM” ning RTS23#35 = „AGRI” ja [RTS2#5 = „FUTR” või „FORW”]	Põllumajandusliku kauba futuuri/-forvardi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#36 ja RTS23#37) – alusvaraks olev põllumajanduslik kaup (alamtoode ja muu alamtoode) **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#15) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles futuuri/forvardi tinglik väärtus on nomineeritud			10 000 000 eurot	10

▼M3

Varaklass – kauba tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest**	
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]
	Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#8) – futuuri/forvardi järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: **Tähtajaklass 1:** 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud **Tähtajaklass 2:** 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud **Tähtajaklass 3:** 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta **Tähtajaklass 4:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat … **Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat		
Põllumajandusliku kauba optsioonid RTS2#3 = „DERV” ja RTS2#4 = „COMM” ning RTS23#35 = „AGRI” ja RTS2#5 = „OPTN”	Põllumajandusliku kauba optsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#36 ja RTS23#37) – alusvaraks olev põllumajanduslik kaup (alamtoode ja muu alamtoode) **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#15) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles optsiooni tinglik väärtus on nomineeritud **Segmenteerimiskriteerium 3** (RTS2#8) – optsiooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: **Tähtajaklass 1:** 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud **Tähtajaklass 2:** 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud **Tähtajaklass 3:** 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta **Tähtajaklass 4:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat … **Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	10 000 000 eurot	10

▼M3

Varaklass – kauba tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest**	
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]
Põllumajandusliku kauba vahetustehingud RTS2#3 = „DERV” ja RTS2#4 = „COMM” ning RTS23#35 = „AGRI” ja RTS2#5 = „SWAP”	Põllumajandusliku kauba vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#36 ja RTS23#37) – alusvaraks olev põllumajanduslik kaup (alamtoode ja muu alamtoode) **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#15) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles vahetustehingu tinglik väärtus on nomineeritud **Segmenteerimiskriteerium 3** (RTS23#34) – tarne liik, mis on määratletud sularahas, füüsilise või valikulisena **Segmenteerimiskriteerium 4** (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: **Tähtajaklass 1:** 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud **Tähtajaklass 2:** 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud **Tähtajaklass 3:** 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta **Tähtajaklass 4:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat … **Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	10 000 000 eurot	10
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat**		
Muud kauba tuletisinstrumendid Kauba tuletisinstrument, mis ei kuulu ühessegi ülalnimetatud varade alamklassi	Mis tahes muud kauba tuletisinstrumenti käsitatakse likviidset turgu mitteomavana		

▼M4

Tabel 7.2

Kauba tuletisinstrumendid – kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille kohta on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg

Varaklass – kauba tuletisinstrumendid									
Varade alamklass	**Kauplemiseelsete ja -järgsete künniste arvutamisel kohaldatavad protsentiilid ja alumised künnisväärtused instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg**								
	Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse	**Suur maht, kauplemiseelne**		**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**			**Suur maht, kauplemisjärgne**		
		Tehingud – protsentiil	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**
Metallide kaubafutuurid/-forvardid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	500 000 eurot	80	60	750 000 eurot	90	70	1 000 000 eurot
Metallide kaubaoptsioonid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	500 000 eurot	80	60	750 000 eurot	90	70	1 000 000 eurot
Metallide kauba-vahetustehingud	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	500 000 eurot	80	60	750 000 eurot	90	70	1 000 000 eurot

▼M4

Varaklass – kauba tuletisinstrumendid									
Varade alamklass	**Kauplemiseelsete ja -järgsete künniste arvutamisel kohaldatavad protsentiilid ja alumised künnisväärtused instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg**								
	Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse	**Suur maht, kauplemiseelne**		**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**			**Suur maht, kauplemisjärgne**		
		Tehingud – protsentiil	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**
Energia kaubafutuurid/-forvardid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	500 000 eurot	80	60	750 000 eurot	90	70	1 000 000 eurot
Energia kaubaoptsioonid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	500 000 eurot	80	60	750 000 eurot	90	70	1 000 000 eurot
Energia kaubavahetustehingud	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	500 000 eurot	80	60	750 000 eurot	90	70	1 000 000 eurot

▼M4

Varaklass – kauba tuletisinstrumendid									
Varade alamklass	**Kauplemiseelsete ja -järgsete künniste arvutamisel kohaldatavad protsentiilid ja alumised künnisväärtused instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg**								
	Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse	**Suur maht, kauplemiseelne**		**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**			**Suur maht, kauplemisjärgne**		
		Tehingud – protsentiil	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**
Põllumajandusliku kauba futuurid/forvardid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	500 000 eurot	80	60	750 000 eurot	90	70	1 000 000 eurot
Põllumajandusliku kauba optsioonid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	500 000 eurot	80	60	750 000 eurot	90	70	1 000 000 eurot
Põllumajandusliku kauba vahetustehingud	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	500 000 eurot	80	60	750 000 eurot	90	70	1 000 000 eurot

▼M4

Tabel 7.3

Kauba tuletisinstrumendid – kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille kohta on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu

Varaklass – kauba tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu**		
	Suur maht, kauplemiseelne	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
	Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Metallide kaubafutuurid/-forvardid	500 000 eurot	750 000 eurot	1 000 000 eurot
Metallide kaubaoptsioonid	500 000 eurot	750 000 eurot	1 000 000 eurot
Metallide kaubavahetustehingud	500 000 eurot	750 000 eurot	1 000 000 eurot
Energia kaubafutuurid/-forvardid	500 000 eurot	750 000 eurot	1 000 000 eurot
Energia kaubaoptsioonid	500 000 eurot	750 000 eurot	1 000 000 eurot
Energia kaubavahetustehingud	500 000 eurot	750 000 eurot	1 000 000 eurot
Põllumajandusliku kauba futuurid/forvardid	500 000 eurot	750 000 eurot	1 000 000 eurot
Põllumajandusliku kauba optsioonid	500 000 eurot	750 000 eurot	1 000 000 eurot
Põllumajandusliku kauba vahetustehingud	500 000 eurot	750 000 eurot	1 000 000 eurot
Muud kauba tuletisinstrumendid	500 000 eurot	750 000 eurot	1 000 000 eurot

▼B

8. **Välisvaluuta tuletisinstrumendid**

▼M3

Tabel 8.1

Välisvaluuta tuletisinstrumendid – klassid, millel ei ole likviidset turgu

Varaklass – välisvaluuta tuletisinstrumendid			
Finantsinstrument, mis on seotud valuutadega, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktis 4			
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest**	
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]
Mitteülekantav forvard Forvard, mis kuulub lepingu tingimuste kohaselt selle poolte vahel rahas arveldamisele ja mille arveldussumma määratakse kindlaks kahe valuuta kauplemis- ja hindamispäeva vahetuskursi erinevuse põhjal. Arvelduspäeval võlgneb üks pool teisele netoerinevuse i) kauplemispäeval kehtiva vahetuskursi ning ii) hindamispäeva vahetuskursi vahel, lähtudes tinglikust väärtusest ja arvestades, et see netosumma kuulub tasumisele lepingus sätestatud arveldusvaluutas. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FORW RTS2#26 = NDLV	Mitteülekantava välisvaluutaforvardi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#13 ja RTS23#47) – aluseks olevate valuutade paar, mis on määratletud kui kahe tuletislepingu aluseks oleva valuuta kombinatsioon **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – forvardi järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: **Tähtajaklass 1:** 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 nädal **Tähtajaklass 2:** 1 nädal < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud **Tähtajaklass 3:** 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta **Tähtajaklass 4:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat **Tähtajaklass 5:** 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … **Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	Mitteülekantavaid forvardeid käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	

▼M3

Varaklass – välisvaluuta tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest**	
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]
Ülekantav forvard Forvard, mis hõlmab üksnes kahe eri valuuta vahetust teataval tulevasel lepingus kokku lepitud arvelduspäeval ja fikseeritud määraga, mis on kokku lepitud valuutavahetust käsitleva lepingu sõlmimisel. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR' RTS2#5 = FORW RTS2#26 = DLVB	Ülekantava välisvaluutaforvardi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#13 ja RTS23#47) – aluseks olevate valuutade paar, mis on määratletud kui kahe tuletislepingu aluseks oleva valuuta kombinatsioon **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – forvardi järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: **Tähtajaklass 1:** 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 nädal **Tähtajaklass 2:** 1 nädal < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud **Tähtajaklass 3:** 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta **Tähtajaklass 4:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat **Tähtajaklass 5:** 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … **Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	Ülekantavaid forvardeid käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	

▼M3

Varaklass – välisvaluuta tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest**	
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]
Mitteülekantavad välisvaluutaoptsioonid Optsioon, mis kuulub lepingu tingimuste kohaselt selle poolte vahel rahas arveldamisele ja mille arveldussumma määratakse kindlaks kahe valuuta kauplemis- ja hindamispäeva vahetuskursi erinevuse põhjal. Arvelduspäeval võlgneb üks pool teisele netoerinevuse i) kauplemispäeval kehtiva vahetuskursi ning ii) hindamispäeva vahetuskursi vahel, lähtudes tinglikust väärtusest ja arvestades, et see netosumma kuulub tasumisele lepingus sätestatud arveldusvaluutas. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR’ RTS2#5 = OPTN RTS2#26 = NDLV	Mitteülekantava välisvaluutaoptsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#13 ja RTS23#47) – aluseks olevate valuutade paar, mis on määratletud kui kahe tuletislepingu aluseks oleva valuuta kombinatsioon **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – optsiooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: **Tähtajaklass 1:** 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 nädal **Tähtajaklass 2:** 1 nädal < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud **Tähtajaklass 3:** 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta **Tähtajaklass 4:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat **Tähtajaklass 5:** 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … **Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	Mitteülekantavaid välisvaluutaoptsioone käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	

▼M3

Varaklass – välisvaluuta tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest**	
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]
Ülekantavad välisvaluutaoptsioonid Optsioon, mis hõlmab üksnes kahe eri valuuta vahetust teataval tulevasel lepingus kokku lepitud arvelduspäeval ja fikseeritud määraga, mis on kokku lepitud valuutavahetust käsitleva lepingu sõlmimisel. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = OPTN RTS2#26 = DLVB	Ülekantava välisvaluutaoptsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#13 ja RTS23#47) – aluseks olevate valuutade paar, mis on määratletud kui kahe tuletislepingu aluseks oleva valuuta kombinatsioon **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – optsiooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: **Tähtajaklass 1:** 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 nädal **Tähtajaklass 2:** 1 nädal < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud **Tähtajaklass 3:** 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta **Tähtajaklass 4:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat **Tähtajaklass 5:** 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … **Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	Ülekantavaid välisvaluutaoptsioone käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	

▼M3

Varaklass – välisvaluuta tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest**	
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]
Mitteülekantavad välisvaluuta vahetustehingud Vahetustehing, mis kuulub lepingu tingimuste kohaselt selle poolte vahel rahas arveldamisele ja mille arveldussumma määratakse kindlaks kahe valuuta kauplemis- ja hindamispäeva vahetuskursi erinevuse põhjal. Arveldus-päeval võlgneb üks pool teisele netoerinevuse i) kauplemispäeval kehtiva vahetuskursi ning ii) hindamispäeva vahetuskursi vahel, lähtudes tinglikust väärtusest ja arvestades, et see netosumma kuulub tasumisele lepingus sätestatud arveldusvaluutas. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR'** RTS2#5 = SWAP RTS2#26 = NDLV	Mitteülekantava välisvaluuta vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#13 ja RTS23#47) – aluseks olevate valuutade paar, mis on määratletud kui kahe tuletislepingu aluseks oleva valuuta kombinatsioon **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: **Tähtajaklass 1:** 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 nädal **Tähtajaklass 2:** 1 nädal < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud **Tähtajaklass 3:** 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta **Tähtajaklass 4:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat **Tähtajaklass 5:** 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … **Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	Mitteülekantavaid välisvaluuta vahetustehinguid käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	

▼M3

Varaklass – välisvaluuta tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest**	
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]
Ülekantavad välisvaluuta vahetustehingud Vahetustehing, mis hõlmab üksnes kahe eri valuuta vahetust teataval tulevasel lepingus kokku lepitud arvelduspäeval ja fikseeritud määraga, mis on kokku lepitud valuutavahetust käsitleva lepingu sõlmimisel. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = SWAP RTS2#26 = DLVB	Ülekantava välisvaluuta vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#13 ja RTS23#47) – aluseks olevate valuutade paar, mis on määratletud kui kahe tuletislepingu aluseks oleva valuuta kombinatsioon **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: **Tähtajaklass 1:** 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 nädal **Tähtajaklass 2:** 1 nädal < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud **Tähtajaklass 3:** 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta **Tähtajaklass 4:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat **Tähtajaklass 5:** 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … **Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	Ülekantavaid välisvaluuta vahetustehinguid käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	

▼M3

Varaklass – välisvaluuta tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest**	
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]
Välisvaluutafutuurid **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR'** RTS2#5 = FUTR	Välisvaluutafutuuri alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#13 ja RTS23#47) – aluseks olevate valuutade paar, mis on määratletud kui kahe tuletislepingu aluseks oleva valuuta kombinatsioon **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – futuuri järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: **Tähtajaklass 1:** 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 nädal **Tähtajaklass 2:** 1 nädal < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud **Tähtajaklass 3:** 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta **Tähtajaklass 4:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat **Tähtajaklass 5:** 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … **Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	Välisvaluutafutuure käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	

Varaklass – välisvaluuta tuletisinstrumendid	
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat**
Muud välisvaluuta tuletisinstrumendid Välisvaluuta tuletisinstrument, mis ei kuulu ühessegi ülalnimetatud varade alamklassi RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = OTHR	Mis tahes muud välisvaluuta tuletisinstrumenti käsitatakse likviidset turgu mitteomavana

▼M4

Tabel 8.2

Välisvaluuta tuletisinstrumendid – kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille kohta on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu

Varaklass – välisvaluuta tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu**		
	Suur maht, kauplemiseelne	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
	Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Mitteülekantav forvard	5 000 000 eurot	20 000 000 eurot	25 000 000 eurot
Ülekantav forvard	5 000 000 eurot	20 000 000 eurot	25 000 000 eurot
Mitteülekantavad välisvaluutaoptsioonid	5 000 000 eurot	20 000 000 eurot	25 000 000 eurot
Ülekantavad välisvaluutaoptsioonid	5 000 000 eurot	20 000 000 eurot	25 000 000 eurot
Mitteülekantavad välisvaluuta vahetustehingud	5 000 000 eurot	20 000 000 eurot	25 000 000 eurot
Ülekantavad välisvaluuta vahetustehingud	5 000 000 eurot	20 000 000 eurot	25 000 000 eurot
Välisvaluutafutuurid	5 000 000 eurot	20 000 000 eurot	25 000 000 eurot
Muud välisvaluuta tuletisinstrumendid	5 000 000 eurot	20 000 000 eurot	25 000 000 eurot

▼B

9. **Krediidituletisinstrumendid**

▼M3

Tabel 9.1

Krediidituletisinstrumendid – klassid, millel ei ole likviidset turgu

Varaklass – krediidituletisinstrumendid				
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi**		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Indeksi staatus *on-the-run*** [täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium]
Indeksipõhine krediidiriski vahetustehing – vahetustehing, mille rahavoogude vahetamine on seotud indeksisse kuuluvate finantsinstrumentide mitme emitendi krediidivõimelisusega ja krediidisündmuste toimumisega **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	Indeksipõhise krediidiriski vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS2#34) – aluseks olev indeks **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#42) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles tuletisinstrumendi tinglik väärtus on nomineeritud **Segmenteerimiskriteerium 3** (RTS2#8) – krediidiriski vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: **Tähtajaklass 1:** 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta **Tähtajaklass 2:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat **Tähtajaklass 3:** 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … **Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	200 000 000 eurot	10	Aluseks olevat indeksit käsitatakse likviidset turgu omavana: 1. kogu sellisel perioodil, mil staatus on „*on-the-run*”; 2. sellise perioodi esimese 30 tööpäeva jooksul, mil staatus on „1x *off-the-run*”. *On-the-run-indeks tähendab jooksvat kõige viimast versiooni (seeriat) indeksist, mis on loodud sel kuupäeval, millal indeksi koostis kehtima hakkab, ja lõpeb üks päev enne kuupäeva, millal indeksi järgmise versiooni (seeria) koostis kehtima hakkab.* Staatus 1x *off-the-run tähendab indeksi seda versiooni (seeriat), mis eelneb vahetult kehtivale on-the-run-versioonile (seeriale) teataval ajahetkel. Versioon (seeria) ei ole enam on-the-run ja saab staatuse 1x off-the-run, kui luuakse indeksi värskeim versioon (seeria).*

▼M3

Varaklass – krediidituletisinstrumendid				
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi**		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Indeksi staatus *on-the-run*** [täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium]
Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehing – vahetustehing, mille rahavoogude vahetamine on seotud finantsinstrumentide ühe emitendi krediidivõimelisusega ja krediidisündmuste toimumisega **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS2#41) – aluseks olev võrdlusüksus **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#39) – aluseks oleva võrdlusüksuse liik, mis on määratletud järgmiselt: „Riigi ja avaliku sektori tüüpi emitent” on emiteeriv üksus, mis on kas: a. liit; b. liikmesriik, k.a liikmesriigi valitsusasutus, amet või eriotstarbeline üksus; c. riigi üksus, mis ei ole loetletud punktides a ja b; d. liitriigist liikmesriigi puhul liitriigi liige; e. mitme liikmesriigi eriotstarbeline üksus; f. rahvusvaheline finantsasutus, mille on asutanud vähemalt kaks liikmesriiki ja mille eesmärk on koondada rahalisi vahendeid ning anda rahalist abi oma liikmetele, kellel on või keda ohustavad ulatuslikud finantsprobleemid;	10 000 000 eurot	10	

▼M3

Varaklass – krediidituletisinstrumendid				
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi**		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Indeksi staatus *on-the-run*** [täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium]
	g. Euroopa Investeerimispank; h. avaliku sektori asutus, mis ei ole avaliku sektori emitent, nagu on täpsustatud punktides a–c. „Äriühingu tüüpi emitent” on emiteeriv üksus, mis ei ole riigi ega avaliku sektori tüüpi emitent. **Segmenteerimiskriteerium 3** (RTS2#42) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles tuletisinstrumendi tinglik väärtus on nomineeritud **Segmenteerimiskriteerium 4** (RTS2#8) – krediidiriski vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: **Tähtajaklass 1:** 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta **Tähtajaklass 2:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat **Tähtajaklass 3:** 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … **Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat			
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta järgmisele kvalitatiivsele likviidsuse kriteeriumile**		
Krediidiriski vahetustehingu indeksi optsioonid – optsioon, mille aluseks on krediidiriski vahetustehingu indeks	Krediidiriski vahetustehingu indeksi optsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.	Krediidiriski vahetustehingu indeksi optsiooni, mille aluseks olev krediidiriski vahetustehingu indeks on alamklass, mille puhul on määratud kindlaks, et sellel on likviidne turg, ja mille järelejäänud tähtaja klass on 0–6 kuud, käsitatakse likviidset turgu omavana		

▼M3

Varaklass – krediidituletisinstrumendid				
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi**		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Indeksi staatus *on-the-run*** [täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium]
RTS2#3 = DERV **RTS2#4 = CRDT**	**Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#26) – krediidiriski vahetustehingu indeksi alamklass, nagu on määratletud indeksipõhise krediidiriski vahetustehingu vara alamklassi puhul **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS2#8) – optsiooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: **Tähtajaklass 1:** 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud **Tähtajaklass 2:** 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta **Tähtajaklass 3:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat **Tähtajaklass 4:** 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … **Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	Krediidiriski vahetustehingu indeksi optsiooni, mille aluseks olev krediidiriski vahetustehingu indeks on alamklass, mille puhul on määratud kindlaks, et sellel on likviidne turg, ja mille järelejäänud tähtaja klass ei ole 0–6 kuud, käsitatakse likviidset turgu mitteomavana Krediidiriski vahetustehingu indeksi optsiooni, mille aluseks olev krediidiriski vahetustehingu indeks on alamklass, mille puhul on määratud kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu, käsitatakse mis tahes järelejäänud tähtaja klassi puhul likviidset turgu mitteomavana		
Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu optsioonid – optsioon, mille alusvara on ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehing **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu optsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS23#26) – ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu alamklass, nagu on määratletud ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu vara alamklassi puhul	Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu optsiooni, mille alusvaraks olev ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehing on alamklass, mille puhul on määratud kindlaks, et sellel on likviidne turg, ning mille järelejäänud tähtaja klass on 0–6 kuud, käsitatakse likviidset turgu omavana Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu optsiooni, mille alusvaraks olev ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehing on alamklass, mille puhul on määratud kindlaks, et sellel on likviidne turg, ning mille järelejäänud tähtaja klass ei ole 0–6 kuud, käsitatakse likviidset turgu mitteomavana		

▼M3

Varaklass – krediidituletisinstrumendid				
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi**		
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]	**Indeksi staatus *on-the-run*** [täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium]
	Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – optsiooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: **Tähtajaklass 1:** 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud **Tähtajaklass 2:** 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta **Tähtajaklass 3:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat **Tähtajaklass 4:** 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … **Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat	Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu optsiooni, mille alusvaraks olev ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehing on alamklass, mille puhul on määratud kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu, käsitatakse mis tahes järelejäänud tähtaja klassi puhul likviidset turgu mitteomavana		

Varaklass – krediidituletisinstrumendid	
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat**
Muud krediidituletisinstrumendid – krediidituletisinstrument, mis ei kuulu ühessegi ülalnimetatud varade alamklassi **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT RTS2#5 = OTHR**	Mis tahes muud krediidituletisinstrumenti käsitatakse likviidset turgu mitteomavana

▼M4

Tabel 9.2

Krediidituletisinstrumendid – kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg

Varaklass – krediidituletisinstrumendid									
Varade alamklass	**Kauplemiseelsete ja -järgsete künniste arvutamisel kohaldatavad protsentiilid ja alumised künnisväärtused instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg**								
	Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse	**Suur maht, kauplemiseelne**		**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**			**Suur maht, kauplemisjärgne**		
		Tehingud – protsentiil	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**
Indeksipõhine krediidiriski vahetustehing	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	5 000 000 eurot	80	60	7 500 000 eurot	90	70	10 000 000 eurot
Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehing	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	5 000 000 eurot	80	60	7 500 000 eurot	90	70	10 000 000 eurot
Krediidiriski vahetustehingu indeksi optsioonid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	5 000 000 eurot	80	60	7 500 000 eurot	90	70	10 000 000 eurot

▼M4

Varaklass – krediidituletisinstrumendid									
Varade alamklass	**Kauplemiseelsete ja -järgsete künniste arvutamisel kohaldatavad protsentiilid ja alumised künnisväärtused instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg**								
	Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse	**Suur maht, kauplemiseelne**		**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**			**Suur maht, kauplemisjärgne**		
		Tehingud – protsentiil	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**
Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu optsioonid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	5 000 000 eurot	80	60	7 500 000 eurot	90	70	10 000 000 eurot

Tabel 9.3

Krediidituletisinstrumendid – kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu

Varaklass – krediidituletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu**		
	Suur maht, kauplemiseelne	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
	Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Indeksipõhine krediidiriski vahetustehing	5 000 000 eurot	7 500 000 eurot	10 000 000 eurot
Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehing	5 000 000 eurot	7 500 000 eurot	10 000 000 eurot
Krediidiriski vahetustehingu indeksi optsioonid	5 000 000 eurot	7 500 000 eurot	10 000 000 eurot
Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu optsioonid	5 000 000 eurot	7 500 000 eurot	10 000 000 eurot
Muud krediidituletisinstrumendid	5 000 000 eurot	7 500 000 eurot	10 000 000 eurot

▼B

10. **C10 tuletisinstrumendid**

▼M3

Tabel 10.1

C10 tuletisinstrumendid – klassid, millel ei ole likviidset turgu

Varaklass – C10 tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest**	
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]
Veose tuletisinstrumendid Finantsinstrument, mis on seotud prahirahaga, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktis 10 RTS2#3 = „DERV” ja RTS2#4 = „COMM” ning RTS23#35 = „FRGT”	Veose tuletisinstrumendi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. **Segmenteerimiskriteerium 1** (RTS2#5) – lepingu liik: futuurid või optsioonid **Segmenteerimiskriteerium 2** (RTS23#36) – veose liik **Segmenteerimiskriteerium 3** (RTS2#37) – veose alaliik **Segmenteerimiskriteerium 4** (RTS2#12) – veose alaliigiga seotud mahu määratlus **Segmenteerimiskriteerium 5** (RTS2#13) – kindel marsruut või tähtajalise prahtimise keskmine **Segmenteerimiskriteerium 6** (RTS2#8) – tuletisinstrumendi järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: **Tähtajaklass 1:** 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu **Tähtajaklass 2:** 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud **Tähtajaklass 3:** 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud **Tähtajaklass 4:** 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 9 kuud **Tähtajaklass 5:** 9 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta **Tähtajaklass 6:** 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat	10 000 000 eurot	10

▼M3

Varaklass – C10 tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool**	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest**	
		Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]
	Tähtajaklass 7: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat … **Tähtajaklass m:** (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat		

Varaklass – C10 tuletisinstrumendid	
Varade alamklass	**Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat**
Muud C10 tuletisinstrumendid Direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktis 10 määratletud finantsinstrument, mis ei ole veose tuletisinstrument; mis tahes järgmine intressimäära tuletisinstrumendi alamklassidest: mitmes valuutas või erinevates valuutades inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehing, mitmes valuutas või erinevates valuutades inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forvardid, ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehing, ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forvardid; mis tahes järgmine aktsiatel põhinevate tuletisinstrumentide alamklassidest: volatiilsusindeksioptsioon, volatiilsusindeksifutuur/-forvard, tulususe variatsiooni parameetriga (*parameter return variance*) vahetustehing, volatiilsuse tulususe parameetriga (*parameter return volatility*) vahetustehing, tulususe variatsiooni parameetriga (*parameter return variance*) portfellivahetustehing, tulususe volatiilsuse parameetriga (*parameter return volatility*) portfellivahetustehing	Mis tahes muid C10 tuletisinstrumente käsitatakse likviidset turgu mitteomavana

▼M4

Tabel 10.2

C10 tuletisinstrumendid – kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille kohta on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg

Varaklass – C10 tuletisinstrumendid									
Varade alamklass	**Kauplemiseelsete ja -järgsete künniste arvutamisel kohaldatavad protsentiilid ja alumised künnisväärtused instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg**								
	Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse	**Suur maht, kauplemiseelne**		**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**			**Suur maht, kauplemisjärgne**		
		Tehingud – protsentiil	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**
Veose tuletisinstrumendid	Künnised tuleks arvutada iga varade alamklassi alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid	70	50 000 eurot	80	60	75 000 eurot	90	70	100 000 eurot

Tabel 10.3

C10 tuletisinstrumendid – kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille kohta on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu

Varaklass – C10 tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu**		
	Suur maht, kauplemiseelne	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
	Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Veose tuletisinstrumendid	50 000 eurot	75 000 eurot	100 000 eurot
Muud C10 tuletisinstrumendid	50 000 eurot	75 000 eurot	100 000 eurot

▼B

11. **Hinnavahelepingud**

▼M3

Tabel 11.1

Hinnavahelepingud – klassid, millel ei ole likviidset turgu

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Kvalitatiivne likviidsuse kriteerium	Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]
Valuuta hinnavahelepingud RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = CURR	Valuuta hinnavahelepingute alamklass määratakse kindlaks aluseks olevate valuutade paari põhjal, mis on määratletud kui hinnavahelepingu / hinnavahekihlveo lepingu aluseks oleva kahe valuuta kombinatsioon RTS2#30 ja RTS2#31		50 000 000 eurot	100
Kauba hinnavahelepingud RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = COMM	Kauba hinnavahelepingute alamklass määratakse kindlaks hinnavahelepingu / hinnavahekihlveo lepingu alusvaraks oleva kauba põhjal RTS23#35 ja RTS23#36 ning RTS23#37		50 000 000 eurot	100
Kapitali hinnavahelepingud RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = EQUI	Kapitali hinnavahelepingute alamklass määratakse kindlaks hinnavahelepingu / hinnavahekihlveo lepingu alusvaraks oleva kapitaliväärtpaberi põhjal RTS23#26	Kapitali hinnavahelepingu alamklassi käsitatakse likviidset turgu omavana, kui alusvara on kapitaliväärtpaber, millel on likviidne turg, nagu on kindlaks määratud kooskõlas määruse (EL) nr 600/2014 artikli 2 lõike 1 punkti 17 alapunktiga b		
Võlakirjade hinnavahelepingud RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = BOND	Võlakirja hinnavahelepingute alamklass määratakse kindlaks hinnavahelepingu / hinnavahekihlveo lepingu alusvaraks oleva võlakirja või võlakirjafutuuri põhjal RTS23#26	Võlakirja hinnavahelepingu alamklassi käsitatakse likviidset turgu omavana, kui alusvara on võlakiri või võlakirjafutuur, millel on likviidne turg, nagu on kindlaks määratud kooskõlas artikliga 6 ja artikli 8 lõike 1 punktiga b.		

▼M3

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool	Kvalitatiivne likviidsuse kriteerium	Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]
Aktsiafutuuri/-forvardi hinnavahelepingud RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = FTEQ	Aktsiafutuuri/-forvardi hinnavahelepingu alamklass määratakse kindlaks hinnavahelepingu / hinnavahekihlveo lepingu alusvaraks oleva aktsiafutuuri/-forvardi põhjal RTS23#26	Aktsiafutuuri/-forvardi hinnavahelepingu alamklassi käsitatakse likviidset turgu omavana, kui alusvara on aktsiafutuur/-forvard, millel on likviidne turg, nagu on kindlaks määratud kooskõlas artikliga 6 ja artikli 8 lõike 1 punktiga b.		
Aktsiaoptsiooni hinnavahelepingud RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OPEQ	Aktsiaoptsiooni hinnavahelepingu alamklass määratakse kindlaks hinnavahelepingu / hinnavahekihlveo lepingu alusvaraks oleva aktsiaoptsiooni põhjal RTS23#26	Aktsiaoptsiooni hinnavahelepingu alamklassi käsitatakse likviidset turgu omavana, kui alusvara on aktsiaoptsioon, millel on likviidne turg, nagu on kindlaks määratud kooskõlas artikliga 6 ja artikli 8 lõike 1 punktiga b.		

Varaklass – hinnavahelepingud

Varade alamklass	Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat
Muud hinnavahelepingud	
Hinnavaheleping / hinnavahekihlveo leping, mis ei kuulu ühessegi ülalnimetatud varade alamklassi RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OTHR	Mis tahes muid hinnavahelepinguid / hinnavahekihlveo lepinguid käsitatakse likviidset turgu mitteomavana

▼M4

Tabel 11.2

Hinnavahelepingud – kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille kohta on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg

Varaklass – hinnavahelepingud									
Varade alamklass	**Kauplemiseelsete ja -järgsete künniste arvutamisel kohaldatavad protsentiilid ja alumised künnisväärtused instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg**								
	Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse	**Suur maht, kauplemiseelne**		**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**			**Suur maht, kauplemisjärgne**		
		Tehingud – protsentiil	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**
Valuuta hinnavahelepingud	Tehingud, mis on tehtud valuuta hinnavahelepingutega, mida käsitatakse likviidset turgu omavana vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b	70	60 000 eurot	80	60	90 000 eurot	90	70	100 000 eurot
Kauba hinnavahelepingud	Tehingud, mis on tehtud kauba hinnavahelepingutega, mida käsitatakse likviidset turgu omavana vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b	70	60 000 eurot	80	60	90 000 eurot	90	70	100 000 eurot
Kapitali hinnavahelepingud	Tehingud, mis on tehtud kapitali hinnavahelepingutega, mida käsitatakse likviidset turgu omavana vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b	70	60 000 eurot	80	60	90 000 eurot	90	70	100 000 eurot
Võlakirjade hinnavahelepingud	Tehingud, mis on tehtud kapitali hinnavahelepingutega, mida käsitatakse likviidset turgu omavana vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b	70	60 000 eurot	80	60	90 000 eurot	90	70	100 000 eurot

▼M4

Varaklass – hinnavahelepingud									
Varade alamklass	**Kauplemiseelsete ja -järgsete künniste arvutamisel kohaldatavad protsentiilid ja alumised künnisväärtused instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg**								
	Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse	**Suur maht, kauplemiseelne**		**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**			**Suur maht, kauplemisjärgne**		
		Tehingud – protsentiil	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Maht – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**
Aktsiafutuuri/-forvardi hinnavahelepingud	Tehingud, mis on tehtud aktsiafutuuri hinnavahelepingutega, mida käsitatakse likviidset turgu omavana vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b	70	60 000 eurot	80	60	90 000 eurot	90	70	100 000 eurot
Aktsiaoptsiooni hinnavahelepingud	Tehingud, mis on tehtud aktsiaoptsiooni hinnavahelepingutega, mida käsitatakse likviidset turgu omavana vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b	70	60 000 eurot	80	60	90 000 eurot	90	70	100 000 eurot

Tabel 11.3

Hinnavahelepingud – kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille kohta on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu

Varaklass – hinnavahelepingud			
Varade alamklass	**Kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu**		
	Suur maht, kauplemiseelne	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
	Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Valuuta hinnavahelepingud	60 000 eurot	90 000 eurot	100 000 eurot
Kauba hinnavahelepingud	60 000 eurot	90 000 eurot	100 000 eurot

▼M4

Varaklass – hinnavahelepingud			
Varade alamklass	**Kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu**		
	Suur maht, kauplemiseelne	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
	Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Kapitali hinnavahelepingud	60 000 eurot	90 000 eurot	100 000 eurot
Võlakirjade hinnavahelepingud	60 000 eurot	90 000 eurot	100 000 eurot
Aktsiafutuuri/-forvardi hinnavahelepingud	60 000 eurot	90 000 eurot	100 000 eurot
Aktsiaoptsiooni hinnavahelepingud	60 000 eurot	90 000 eurot	100 000 eurot
Muud hinnavahelepingud/hinnavahekihlveod	60 000 eurot	90 000 eurot	100 000 eurot

12. **Lubatud heitkoguste väärtpaberid**

Tabel 12.1

Lubatud heitkoguste väärtpaberid – klassid, millel ei ole likviidset turgu

Varaklass – lubatud heitkoguste väärtpaberid	
Selliste varade alamklasside kindlaksmääramiseks, millel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6a, kasutatakse järgmist metoodikat.	
Varade alamklass	**Likviidsuse kindlaksmääramine**
Lubatud heitkoguse ühik (LHÜ) on mis tahes ühik, mis on tunnistatud vastavaks Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2003/87/EÜ [1] nõuetele (heitkogustega kauplemise süsteem) ja mis vastab õigusele tekitada heitkogus, mis on samaväärne ühe CO_2 ekvivalenttonniga RTS2#3 = EMAL ja RTS23#37 = EUAE	Lubatud heitkoguse ühikuid (LHÜd) käsitatakse likviidset turgu omavana
Muud lubatud heitkoguste väärtpaberid RTS2#3 = EMAL ja RTS23#37 <> EUAE	Mis tahes muid lubatud heitkoguste väärtpabereid käsitatakse likviidset turgu mitteomavana

[1] Euroopa Parlamendi ja nõukogu 13. oktoobri 2003. aasta direktiiv 2003/87/EÜ, millega luuakse ühenduses kasvuhoonegaaside saastekvootidega kauplemise süsteem ja muudetakse nõukogu direktiivi 96/61/EÜ (ELT L 275, 25.10.2003, lk 32, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2003/87/oj).

▼M4

Tabel 12.2

Lubatud heitkoguste väärtpaberid – kauplemiseelsed künnised suure mahu puhul ja kauplemisjärgsed mahu künnised

Varaklass – lubatud heitkoguste väärtpaberid		
Varade alamklass	**Kauplemiseelne suur maht**	**Kauplemisjärgne mahu künnis**
Lubatud heitkoguse ühikud (LHÜd)	5 000 CO_2 ekvivalenttonni	25 000 CO_2 ekvivalenttonni
Muud lubatud heitkoguste väärtpaberid	Mis tahes maht	Mis tahes maht

▼B

13. **Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid**

▼M3

Tabel 13.1

Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid – klassid, millel ei ole likviidset turgu

	Varaklass – lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid	
Varade alamklass	**Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest**	
	Keskmine päevane väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]
Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid, mille alusvara on lubatud heitkoguse ühiku (LHÜ) tüüpi Finantsinstrument, mis on seotud lubatud heitkoguse ühiku (LHÜ) tüüpi lubatud heitkoguste väärtpaberitega, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktis 4 RTS2#3 = DERV ja RTS2#4 = EMAL ning RTS2#43 = EUAE	150 000 CO2 ekvivalenttonni	5

▼M3

Varade alamklass	Varaklass – lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid	
	Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest	
	Keskmine päevane väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1]	**Keskmine päevane tehingute arv** [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2]
Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid, mille alusvara on lennunduse lubatud heitkoguse ühiku (lennunduse LHÜ) tüüpi Finantsinstrument, mis on seotud lennunduse lubatud heitkoguse ühiku (lennunduse LHÜ) tüüpi lubatud heitkoguste väärtpaberitega, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktis 4 RTS2#3 = DERV ja RTS2#4 = EMAL ning RTS2#43 = EUAA	150 000 CO2 ekvivalenttonni	5
Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid, mille alusvara on tõendatud heitkoguste vähendamise ühiku (THV) tüüpi Finantsinstrument, mis on seotud tõendatud heitkoguste vähendamise ühiku (THV) tüüpi lubatud heitkoguste väärtpaberitega, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktis 4 RTS2#3 = DERV ja RTS2#4 = EMAL ning RTS2#43 = CERE	150 000 CO2 ekvivalenttonni	5
Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid, mille alusvara on heitkoguste vähendamise ühiku (HVÜ) tüüpi Finantsinstrument, mis on seotud heitkoguste vähendamise ühiku (HVÜ) tüüpi lubatud heitkoguste väärtpaberitega, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktis 4 RTS2#3 = DERV ja RTS2#4 = EMAL ning RTS2#43 = ERUE	150 000 CO2 ekvivalenttonni	5
Muud lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrument, mille alusvara on tunnistatud vastavaks direktiivi 2003/87/EÜ nõuetele (heitkogustega kauplemise süsteem) ning mis ei ole lubatud heitkoguse ühik (LHÜ), lennunduse lubatud heitkoguse ühik (lennunduse LHÜ), tõendatud heitkoguste vähendamise ühik (THV) ega heitkoguste vähendamise ühik (HVÜ) RTS2#3 = DERV ja RTS2#4 = EMAL ning RTS2#43 = OTHR	Mis tahes muid lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumente käsitatakse likviidset turgu mitteomavana	

▼M4

Tabel 13.2

Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid – kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille kohta on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg

Varaklass – lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid							
Varade alamklass	**Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse**	**Kauplemiseelsete ja -järgsete künniste arvutamisel kohaldatavad protsentiilid ja alumised künnisväärtused instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul varade alamklasside korral, mille kohta on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg**					
		Suur maht, kauplemiseelne		**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**		**Suur maht, kauplemisjärgne**	
		Tehingud – protsentiil	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**
Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid, mille alusvara on lubatud heitkoguse ühiku (LHÜ) tüüpi	Tehingud kõikide lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentidega, mille alusvara on lubatud heitkoguse ühiku (LHÜ) tüüpi	70	50 000 tonni süsinikdioksiidi	80	90 000 tonni süsinikdioksiidi	90	100 000 tonni süsinikdioksiidi
Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid, mille alusvara on lennunduse lubatud heitkoguse ühiku (lennunduse LHÜ) tüüpi	Tehingud kõikide lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentidega, mille alusvara on lennunduse lubatud heitkoguse ühiku (lennunduse LHÜ) tüüpi	70	25 000 tonni süsinikdioksiidi	80	40 000 tonni süsinikdioksiidi	90	50 000 tonni süsinikdioksiidi
Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid, mille alusvara on tõendatud heitkoguste vähendamise ühiku (THV) tüüpi	Tehingud kõikide lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentidega, mille alusvara on tõendatud heitkoguste vähendamise ühiku (THV) tüüpi	70	25 000 tonni süsinikdioksiidi	80	40 000 tonni süsinikdioksiidi	90	50 000 tonni süsinikdioksiidi

▼M4

Varaklass – lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid							
Varade alamklass	**Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse**	**Kauplemiseelsete ja -järgsete künniste arvutamisel kohaldatavad protsentiilid ja alumised künnisväärtused instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul varade alamklasside korral, mille kohta on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg**					
		Suur maht, kauplemiseelne		**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**		**Suur maht, kauplemisjärgne**	
		Tehingud – protsentiil	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**	**Tehingud – protsentiil**	**Alumine künnisväärtus**
Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid, mille alusvara on heitkoguste vähendamise ühiku (HVÜ) tüüpi	Tehingud kõikide lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentidega, mille alusvara on heitkoguste vähendamise ühiku (HVÜ) tüüpi	70	25 000 tonni süsinikdioksiidi	80	40 000 tonni süsinikdioksiidi	90	50 000 tonni süsinikdioksiidi

Tabel 13.3

Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid – kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille kohta on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu

Varaklass – lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul varade alamklasside korral, mille kohta on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu**		
	Suur maht, kauplemiseelne	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
	Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid, mille alusvara on lubatud heitkoguse ühiku (LHÜ) tüüpi	50 000 tonni süsinikdioksiidi	90 000 tonni süsinikdioksiidi	100 000 tonni süsinikdioksiidi
Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid, mille alusvara on lennunduse lubatud heitkoguse ühiku (lennunduse LHÜ) tüüpi	25 000 tonni süsinikdioksiidi	40 000 tonni süsinikdioksiidi	50 000 tonni süsinikdioksiidi

▼M4

Varaklass – lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid			
Varade alamklass	**Kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul varade alamklasside korral, mille kohta on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu**		
	Suur maht, kauplemiseelne	**Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne**	**Suur maht, kauplemisjärgne**
	Künnisväärtus	**Künnisväärtus**	**Künnisväärtus**
Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid, mille alusvara on tõendatud heitkoguste vähendamise ühiku (THV) tüüpi	25 000 tonni süsinikdioksiidi	40 000 tonni süsinikdioksiidi	50 000 tonni süsinikdioksiidi
Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid, mille alusvara on heitkoguste vähendamise ühiku (HVÜ) tüüpi	25 000 tonni süsinikdioksiidi	40 000 tonni süsinikdioksiidi	50 000 tonni süsinikdioksiidi
Muud lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid	25 000 tonni süsinikdioksiidi	40 000 tonni süsinikdioksiidi	50 000 tonni süsinikdioksiidi

▼B

IV LISA

Läbipaistvusega seotud arvutuste eesmärgil esitatavad võrdlusandmed

▼M3
▼C1

Tabel 1

Tabelis 2 kasutatavad tähised

TÄHIS	ANDMETE LIIK	MÄÄRATLUS
{ALPHANUM-n}	Kuni n tähtnumbrilist märki	Vabateksti väli
{DECIMAL-n/m}	Kuni n-kohaline kümnendarv, milles võib olla m kohta pärast koma	Andmeväljale kantakse kas positiivne või negatiivne arv. 1. kümnendkohtade eraldusmärk on punkt (.); 2. arvu ees võib olla miinusmärk (–), mis tähistab negatiivset väärtust. Vajaduse korral väärtused ümardatakse, neid ei kärbita.
{COUNTRYCODE_2}	2 tähtnumbrilist märki	Kahetäheline riigikood (ISO 3166-1 alpha-2 riigikood)
{CURRENCYCODE_3}	3 tähtnumbrilist märki	Kolmetäheline valuutakood (ISO 4217 valuutakood)
{DATEFORMAT}	ISO 8601 kuupäevavorming	Kuupäevad esitatakse järgmisel kujul: AAAA-KK-PP
{ISIN}	12 tähtnumbrilist märki	ISIN kood, nagu on määratletud standardis ISO 6166
{LEI}	20 tähtnumbrilist märki	Juriidilise isiku tunnus, nagu on määratletud standardis ISO 17442
{MIC}	4 tähtnumbrilist märki	Turu tunnuskood, nagu on määratletud standardis ISO 10383
{EIC}	16 tähtnumbrilist märki	Euroopa Liidus või väljaspool seda asuva tarnekoha EIC-kood
{INDEX}	4 tähtnumbrilist märki	„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

TÄHIS	ANDMETE LIIK	MÄÄRATLUS
		„CIBO” – CIBOR „MOSP” – MOSPRIM „NIBO” – NIBOR „PRBO” – PRIBOR „TLBO” – TELBOR „WIBO” – WIBOR „TREA” – Treasury „SWAP” – SWAP „FUSW” – Future SWAP

▼M3

Tabel 2

Läbipaistvusarvutuste jaoks esitatavate võrdlusandmete üksikasjad

Nr	LAHTER	ESITATAVAD ANDMED	ARUANDE VORMING
1	Finantsinstrumendi tunnuskood	Finantsinstrumendi tuvastamiseks kasutatav kood	{ISIN}
2	Finantsinstrumendi täisnimi	Finantsinstrumendi täielik nimi	{ALPHANUM-350}
3	MiFIRi kohane tunnus	**Mittekapitaliinstrumentide identifitseerimine** **Väärtpaberistatud tuletisinstrumendid**, nagu on määratletud III lisa 4. jao tabelis 4.1 **Struktureeritud finantstooted**, nagu on määratletud määruse (EL) nr 600/2014 artikli 2 lõike 1 punktis 28 **Võlakirjad (kõik võlakirjad, välja arvatud börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad)**, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL artikli 4 lõike 1 punkti 44 alapunktis b **Börsil kaubeldavad kaubad**, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL artikli 4 lõike 1 punkti 44 alapunktis b ja täpsustatud III lisa 2. jao tabelis 2.4 **Börsil kaubeldavad võlakirjad**, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL artikli 4 lõike 1 punkti 44 alapunktis b ja täpsustatud III lisa 2. jao tabelis 2.4 **Lubatud heitkoguste väärtpaberid**, nagu on määratletud III lisa 12. jao tabelis 12.1 **Tuletisinstrumendid**, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktides 4–10	**Mittekapitaliinstrumendid** „SDRV” – väärtpaberistatud tuletisinstrumendid „SFPS” – struktureeritud finantstooted „BOND” – võlakirjad „ETCS” – börsil kaubeldavad kaubad „ETNS” – börsil kaubeldavad võlakirjad „EMAL” – lubatud heitkoguste väärtpaberid „DERV” – tuletisinstrument

▼M3

Nr	LAHTER	ESITATAVAD ANDMED	ARUANDE VORMING
4	Alusvara varaklass	Täidetakse, kui MiFIRi kohane tunnus on väärtpaberistatud tuletisinstrument või tuletisinstrument.	„INTR” – intressimäär „EQUI” – aktsia „COMM” – kaup „CRDT” – krediit „CURR” – valuuta „EMAL” – lubatud heitkoguste väärtpaberid „OCTN” – muu C10
5	Lepingu liik	Täidetakse, kui MiFIRi kohane tunnus on tuletisinstrument.	„OPTN” – optsioonid „FUTR” – futuurid (sh veoste forvardid) „FRAS” – intressiforvardid „FORW” – forvardid „SWAP” – vahetustehingud „PSWP” – portfellivahetustehingud „SWPT” – vahetusoptsioonid „OPTS” – vahetustehingu optsioonid „FONS” – vahetustehingu futuurid „FWOS” – vahetustehingu forvardid „SPDB” – hinnavahekihlveod „CFDS” – hinnavahelepingud „OTHR” – muu
6	Aruandepäev	Võrdlusandmete esitamise päev	{DATEFORMAT}
7	Kauplemiskoht	Kauplemiskoha puhul segmendi MIC (olemasolu korral) või muul juhul korraldaja MIC	{MIC}
8	Tähtaeg	Finantsinstrumendi määratud tähtaeg. Lahter täidetakse võlakirjade, intressimäära tuletisinstrumentide, aktsiatel põhinevate tuletisinstrumentide, kauba tuletisinstrumentide, välisvaluuta tuletisinstrumentide, krediidituletisinstrumentide, C10 tuletisinstrumentide ja lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide varaklasside puhul.	{DATEFORMAT}

Võlakirjadega (kõik võlakirjaliigid, v.a börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad) seotud lahtrid

Selles jaos olevad lahtrid täidetakse üksnes võlakirjade puhul, nagu on määratletud III lisa 2. jao tabelis 2.1.

9	Võlakirjaliik	Võlakirjaliik, nagu on määratletud III lisa 2. jao tabelis 2.2. Täidetakse üksnes siis, kui MiFIRi kohane tunnus võrdub võlakirjadega.	„EUSB” – riigivõlakiri „OEPB” – muu avaliku sektori võlakiri „CVTB” – vahetusvõlakiri „CVDB” – pandikiri „CRPB” – äriühingu võlakiri „OTHR” – muu

▼M3

10	Emiteerimise kuupäev	Kuupäev, millal võlakiri emiteeritakse ja hakkab koguma intressi.	{DATEFORMAT}

Lubatud heitkoguste väärtpaberitega seotud lahtrid

Selles jaos olevad lahtrid täidetakse üksnes lubatud heitkoguste väärtpaberite puhul, nagu on määratletud III lisa 12. jao tabelis 12.1.

11	Lubatud heitkoguste väärtpaberite alamliik	Lubatud heitkoguste väärtpaberid	„CERE” – THV „ERUE” – HVÜ „EUAE” – LHÜ „EUAA” – lennunduse LHÜ „OTHR” – muu

Tuletisinstrumentidega seotud lahtrid

Kauba tuletisinstrumendid ja C10 tuletisinstrumendid

Selles jaos olevad lahtrid täidetakse üksnes kauba tuletisinstrumentide puhul, nagu on määratletud III lisa 7. jao tabelis 7.1, ja C10 tuletisinstrumentide puhul, nagu on määratletud III lisa 10. jao tabelis 10.1.

12	Veose alaliigiga seotud mahu määratlus	Täita, kui delegeeritud määruse (EL) 2017/585 lisa tabeli 2 lahtris 35 märgitud põhitoode võrdub veosega.	Kuivlasti puhul: „CAPE” – Capesize „PNMX” – Panamax „SPMX” – Supramax „HAND” – Handysize Vedellasti puhul: „CLAN” – puhas „DRTY” – must {ALPHANUM-4} muul juhul
13	Kindel marsruut või tähtajalise prahtimise keskmine	Täita, kui delegeeritud määruse (EL) 2017/585 lisa tabeli 2 lahtris 35 märgitud põhitoode võrdub veosega.	Vedellasti puhul: „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

			Kuivlasti puhul: „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} muul juhul
14	Tarne/sularahaarvelduse koht	Täita, kui delegeeritud määruse (EL) 2017/585 lisa tabeli 2 lahtris 35 märgitud põhitoode võrdub energiaga.	{EIC} elektri või maagaasi puhul „OTHR” – muu
15	Tinglik valuuta	Valuuta, milles tinglik väärtus on nomineeritud.	{CURRENCYCODE_3}

Intressimäära tuletisinstrumendid

Selles jaos olevad lahtrid täidetakse üksnes intressimäära tuletisinstrumentide puhul, nagu on määratletud III lisa 5. jao tabelis 5.1.

16	Alusvara liik	Täidetakse lepinguliikide puhul, mis ei ole vahetustehingud, vahetusoptsioonid, vahetustehingu futuurid ega vahetustehingu forvardid, ühega järgmistest variantidest ********** Täidetakse lepinguliikide puhul, mis on vahetustehingud, vahetusoptsioonid, vahetustehingu optsioonid, vahetustehingu futuurid ja vahetustehingu forvardid, seoses alusvaraks oleva vahetustehinguga ühega järgmistest variantidest	„BOND” – võlakiri „BNDF” – võlakirjafutuurid „INTR” – intressimäär „IFUT” – intressimäärafutuur ********** „FFMC” – MITMES VALUUTAS UJUV-MÄÄR-UJUVA-MÄÄRA-VASTU-VAHETUSTEHINGUD „XFMC” – MITMES VALUUTAS FIKSEERITUD-MÄÄR-UJUVA-MÄÄRA-VASTU-VAHETUSTEHINGUD „XXMC” – MITMES VALUUTAS FIKSEERITUD-MÄÄR-FIKSEERITUD-MÄÄRA-VASTU-VAHETUSTEHINGUD „OSMC” – MITMES VALUUTAS ÜLEÖÖ INTRESSIMÄÄRA VAHETUSTEHINGUD „IFMC” – MITMES VALUUTAS INFLATSIOONIINDEKSIGA SEOTUD VAHETUSTEHINGUD „FFSC” – ÜHES VALUUTAS UJUV-MÄÄR-UJUVA-MÄÄRA-VASTU-VAHETUSTEHINGUD „XFSC” – ÜHES VALUUTAS FIKSEERITUD-MÄÄR-UJUVA-MÄÄRA-VASTU-VAHETUSTEHINGUD

▼**M3**

			„XXSC” – ÜHES VALUUTAS FIKSEERITUD-MÄÄR-FIKSEERITUD-MÄÄRA-VASTU-VAHETUSTEHINGUD „OSSC” – ÜHES VALUUTAS ÜLEÖÖ INTRESSIMÄÄRA VAHETUSTEHINGUD „IFSC” – ÜHES VALUUTAS INFLATSIOONIINDEKSIGA SEOTUD VAHETUSTEHINGUD
17	Alusvaraks oleva võlakirja emitent	Täidetakse, kui alusvara liik on võlakiri või võlakirjafutuur, märkides otsese või lõpliku alusvaraks oleva võlakirja emitendi juriidilise isiku tunnuse.	{LEI}
18	Alusvaraks oleva võlakirja tähtaeg	Lahtrisse märgitakse alusvaraks oleva võlakirja määratud tähtaeg.	{DATEFORMAT}
19	Alusvaraks oleva võlakirja emiteerimise kuupäev	Lahtrisse märgitakse alusvaraks oleva võlakirja emiteerimise kuupäev.	{DATEFORMAT}
20	Vahetusoptsiooni tinglik valuuta	Täidetakse üksnes vahetusoptsioonide puhul.	{CURRENCYCODE_3}
21	Alusvaraks oleva vahetustehingu tähtaeg	Täidetakse üksnes vahetusoptsioonide, vahetustehingu optsioonide, vahetustehingu futuuride ja vahetustehingu forvardite puhul.	{DATEFORMAT}
22	Inflatsiooniindeksi ISIN kood / alusvaraks oleva võlakirja ISIN kood	Vahetusoptsioonide korral üks järgmistest alusvaraks oleva vahetustehingu liikidest: ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehing, ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forvardid, mitmes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehing, mitmes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingu futuurid/forvardid; kui inflatsiooniindeksil on ISIN, tuleb lahtrisse märkida selle indeksi ISIN kood. ********** Võlakirjaoptsioonide, võlakirjaoptsiooni optsioonide ja võlakirjafutuuri optsioonide puhul tuleb lahtrisse märkida lõpliku alusvaraks oleva võlakirja ISIN kood.	{ISIN} ********** {ISIN}

▼M3

23	Inflatsiooniindeksi nimetus	Märgitakse indeksi standardnimetus vahetusoptsioonide korral, mis on seotud ühe järgmise aluseks oleva vahetustehingu liigiga: ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehing, ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forvardid, mitmes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehing, mitmes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingu futuurid/forvardid.	{ALPHANUM-25}
24	Viiteintressimäär	Viiteintressimäära nimi.	{INDEX} või {ALPHANUM-25} kui indeksi nime ei ole nimekirjas {INDEX}
25	Aluseks oleva intressimäära tähtaeg	Sellesse lahtrisse märgitakse lepingu aluseks oleva intressimäära tähtaeg. Tähtaega väljendatakse päevades, nädalates, kuudes või aastates. Alustades suurimast tähtajaühikust (aastad) ja liikudes väikseima suunas; kui intressimäära tähtaeg on täisarv, märgitakse sellesse lahtrisse selline standardtähtaeg.	{INTEGER-3}+„DAYS” – päevad {INTEGER-3}+„WEEK” – nädalad {INTEGER-3}+„MNTH” – kuud {INTEGER-3}+„YEAR” – aastad

Välisvaluuta tuletisinstrumendid

Selles jaos olevad lahtrid täidetakse üksnes välisvaluuta tuletisinstrumentide puhul, nagu on määratletud III lisa 8. jao tabelis 8.1.

26	Lepingu alaliik	Täita, et eristada ülekantavaid ja mitteülekantavaid forvardeid, optsioone ning vahetustehinguid, nagu on määratletud III lisa 8. jao tabelis 8.1.	„DLVB” – ülekantav „NDLV” – mitteülekantav

Aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid

Lahtrid täidetakse üksnes aktsiatel põhinevate tuletisinstrumentide puhul, nagu on määratletud III lisa 6. jao tabelis 6.1.

27	Alusvara liik	Täita, kui MiFIRi kohane tunnus on tuletisinstrument, alusvara varaklass on aktsia ja varaklassi alamklass ei ole vahetustehing ega portfellivahetustehing.	„STIX” – aktsiaindeks „SHRS” – aktsia „DIVI” – dividendiindeks „DVSE” – aktsiadividend „BSKT” – korporatiivsetest sündmustest tulenevate aktsiate korv „ETFS” – börsil kaubeldavad fondid „VOLI” – volatiilsusindeks „OTHR” – muu (sh hoidmistunnistused, sertifikaadid ja muu kapital, näiteks finantsinstrumendid)

▼M3

		********** Täita, kui MiFIRi kohane tunnus on tuletisinstrument, alusvara varaklass on aktsia ja varaklassi alamklass on kas vahetustehing või portfellivahetustehing ning III lisa 6. jao tabeli 6.1 kohane segmenteerimiskriteerium 2 on üks alusvara.	********** „SHRS” – aktsia „DVSE” – aktsiadividend „ETFS” – börsil kaubeldavad fondid „OTHR” – muu (sh hoidmistunnistused, sertifikaadid ja muu kapital, näiteks finantsinstrumendid)
		********** Täita, kui MiFIRi kohane tunnus on tuletisinstrument, alusvara varaklass on aktsia ja varaklassi alamklass on kas vahetustehing või portfellivahetustehing ning III lisa 6. jao tabeli 6.1 kohane segmenteerimiskriteerium 2 on indeks.	********** „STIX” – aktsiaindeks „DIVI” – dividendiindeks „VOLI” – volatiilsusindeks „OTHR” – muu
		********** Täita, kui MiFIRi kohane tunnus on tuletisinstrument, alusvara varaklass on aktsia ja varaklassi alamklass on kas vahetustehing või portfellivahetustehing ning III lisa 6. jao tabeli 6.1 kohane segmenteerimiskriteerium 2 on korv.	********** „BSKT” – korv
28	Parameeter	Täita, kui MiFIRi kohane tunnus on tuletisinstrument, alusvara varaklass on aktsia ja varaklassi alamklass on üks järgmistest: vahetustehingud, portfellivahetustehingud.	„PRBP” – hinna ja tulususe näitaja põhiparameeter (*price return basic performance parameter*) „PRDV” – dividendi tulususe parameeter (*parameter return dividend*) „PRVA” – tulususe variatsiooni parameeter (*parameter return variance*) „PRVO” – tulususe volatiilsuse parameeter (*parameter return volatility*)

Hinnavahelepingud

Lahtrid täidetakse üksnes siis, kui lepingu liik on võrdne hinnavahelepingu või hinnavahekihlveoga.

29	Alusvara liik	Täita üksnes siis, kui MiFIRi kohane tunnus on tuletisinstrument ja lepingu liik on võrdne hinnavahelepingu või hinnavahekihlveoga.	„CURR” – valuuta „EQUI” – aktsia „BOND” – võlakirjad „FTEQ” – aktsiafutuurid/-forvardid „OPEQ” – aktsiaoptsioonid „COMM” – kaup „EMAL” – lubatud heitkoguste väärtpaberid „OTHR” – muu

▼M3

30	Tinglik valuuta 1	Aluseks olevate valuutade paari valuuta 1. Lahter on asjakohane, kui alusvara liik on valuuta.	{CURRENCYCODE_3}
31	Tinglik valuuta 2	Aluseks olevate valuutade paari valuuta 2. Lahter on asjakohane, kui alusvara liik on valuuta.	{CURRENCYCODE_3}

Krediidituletisinstrumendid

Selles jaos olevad lahtrid täidetakse üksnes krediidituletisinstrumentide puhul, nagu on määratletud III lisa 9. jao tabelis 9.1.

32	Alusvaraks oleva krediidiriski vahetustehingu ISIN kood	Täidetakse krediidiriski vahetustehingu tuletisinstrumentide puhul, märkides alusvaraks oleva vahetustehingu ISIN koodi.	{ISIN}
33	Aluseks oleva indeksi kood	Täidetakse krediidiriski vahetustehingu indeksi tuletisinstrumentide puhul, märkides indeksi ISIN koodi.	{ISIN}
34	Aluseks oleva indeksi nimi	Täidetakse krediidiriski vahetustehingu indeksi tuletisinstrumentide puhul, märkides indeksi standardnimetuse.	{ALPHANUM-25}
35	Seeria	Indeksi koostise seerianumber, kui see on asjakohane. Täidetakse krediidiriski vahetustehingu indeksi või krediidiriski vahetustehingu indeksi tuletisinstrumendi puhul, märkides krediidiriski vahetustehingu indeksi seeria.	{DECIMAL-18/17}
36	Versioon	Seeria uus versioon antakse välja, kui üks koostisosadest satub viivitusse ja indeks tuleb ümber kujundada, et võtta arvesse kõikide koostisosade uut arvu indeksis. Täidetakse krediidiriski vahetustehingu indeksi või krediidiriski vahetustehingu indeksi tuletisinstrumendi puhul, märkides krediidiriski vahetustehingu indeksi versiooni.	{DECIMAL-18/17}
37	Uuendamise kuud (*roll months*)	Kõik kuud, mille jooksul eeldatakse uuendamist, nagu indeksi autor on asjaomasel aastal kehtestanud. Lahtrid tuleb täita iga uuendamise kuu kohta. Täidetakse krediidiriski vahetustehingu indeksi või krediidiriski vahetustehingu indeksi tuletisinstrumendi puhul.	„01”, „02”, „03”, „04”, „05”, „06”, „07”, „08”, „09”, „10”, „11”, „12”
38	Järgmine uuendamise kuupäev	Täidetakse krediidiriski vahetustehingu indeksi või krediidiriski vahetustehingu indeksi tuletisinstrumendi puhul, märkides indeksi järgmise uuendamise kuupäeva, nagu indeksi autor on kehtestanud.	{DATEFORMAT}
39	Riigi ja avaliku sektori tüüpi emitent	Täidetakse, kui ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu või ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu tuletisinstrumendi aluseks olev üksus on avaliku sektori emitent, nagu on määratletud III lisa 9. jao tabelis 9.1.	„TRUE” – aluseks olev üksus on riigi ja avaliku sektori tüüpi emitent „FALSE” – aluseks olev üksus ei ole riigi ega avaliku sektori tüüpi emitent

▼M3

40	Aluseks olev kohustus	Täidetakse ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu tuletisinstrumendi puhul, märkides aluseks oleva kohustuse ISIN koodi.	{ISIN}
41	Aluseks olev üksus	Märgitakse ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu või ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu tuletisinstrumendi aluseks olev üksus.	{COUNTRYCODE_2} või ISO 3166-2 – kahekohaline riigikood, millele järgneb kriips („-”), ja kuni kolmekohaline tähtnumbriline riigi alljaotuse kood või {LEI}
42	Tinglik valuuta	Valuuta, milles tinglik väärtus on nomineeritud.	{CURRENCYCODE_3}

Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid

Selles jaos olevad lahtrid täidetakse üksnes lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide puhul, nagu on määratletud III lisa 13. jao tabelis 13.1.

43	Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide alamliik	Täita, kui muutuja nr 3 „MiFIRi kohane tunnus” on „DERV” – tuletisinstrument ja muutuja nr 4 „Alusvara varaklass” on „EMAL” – lubatud heitkoguste väärtpaberid.	„CERE” – THV „ERUE” – HVÜ „EUAE” – LHÜ „EUAA” – lennunduse LHÜ „OTHR” – muu

▼M3

V LISA

Läbipaistvusarvutuste jaoks esitatavad kvantitatiivsed andmed

Tabel 1

Tabelis 2 kasutatavad tähised

Tähis	Andmete liik	Määratlus
{ALPHANUM-n}	Kuni n tähtnumbrilist märki	Vabateksti lahter
{ISIN}	12 tähtnumbrilist märki	ISIN kood, nagu on määratletud standardis ISO 6166
{MIC}	4 tähtnumbrilist märki	Turu tunnuskood, nagu on määratletud standardis ISO 10383
{DATEFORMAT}	ISO 8601 kuupäevavorming	Kuupäevad tuleb esitada järgmisel kujul: AAAA-KK-PP
{DECIMAL-n/m}	Kuni n-kohaline kümnendarv, milles võib olla m kohta pärast koma	Lahtrisse kantakse kas positiivne või negatiivne arv: kümnendkohtade eraldusmärk on punkt (.); negatiivsete arvude ees on miinus (–); väärtused ümardatakse, neid ei kärbita.
{INTEGER-n}	Kuni n-kohaline täisarv	Lahtrisse kantakse kas positiivne või negatiivne täisarv.

Tabel 2

Mittekapitaliinstrumentide puhul likviidse turu, suuremahulisuse künnise ja finantsinstrumendile omase mahu künnise kindlaksmääramiseks esitatavate andmete üksikasjad

Nr	Lahter	Esitatavad andmed	Täitmis- või avalikustamiskoha liik	Aruande vorming ja standardid
1	Finantsinstrumendi tunnuskood	Finantsinstrumendi tuvastamiseks kasutatav kood	Reguleeritud turg Mitmepoolne kauplemissüsteem Organiseeritud kauplemissüsteem Tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja Kauplemiskoondteabe pakkuja	{ISIN}
2	Täitmise kuupäev	Tehingute tegemise kuupäev	Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja	{DATEFORMAT}

▼**M3**

Nr	Lahter	Esitatavad andmed	Täitmis- või avalikustamiskoha liik	Aruande vorming ja standardid
3	Täitmiskoht	ELi kauplemiskoha või süsteemse täitja segmendi MIC (olemasolu korral) või muul juhul korraldaja MIC Süsteemse täitja segmendi MIC (olemasolu korral) või muul juhul korraldaja MIC MIC-koodi XOFF börsiväliste tehingute puhul Tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustajad liidavad teatava ISINi ja täitmise kuupäeva puhul kõik selle instrumendiga seotud börsivälised kauplemistegevused üheks kogumiks (ISIN, XOFF, täitmise kuupäev).	Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja	Kauplemiskoha või süsteemse täitja {MIC} või „XOFF”
4	Peatatud instrumendi märgis	Märge, kas instrument oli täitmise kuupäeval asjaomases kauplemiskohas kauplemiseks peatatud kogu päeva jooksul. Sellest tulenevalt märgitakse lahtrisse 5 väärtuseks null.	Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem	„TRUE” – kui instrument oli peatatud kogu kauplemispäeva või „FALSE” – kui instrument ei olnud peatatud kogu kauplemispäeva
5	Tehingute koguarv	Täitmise kuupäeval tehtud tehingute koguarv. Tühistatud tehingud jäetakse esitatavatest andmetest välja. Tehinguid, mille suhtes kohaldatakse avalikustamisega viivitamist, arvestatakse andmeid esitavate üksuste esitatavates koondandmetes täitmise kuupäeva alusel. Lahter tuleb igal juhul täita väärtusega, mis on suurem kui null või sellega võrdne. Kogu päeva peatatud instrumentide puhul on lahtri väärtus null.	Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja	{INTEGER-18}
6	Kogumaht	Täitmise kuupäeval tehtud tehingute kogumaht. Mahtu mõõdetakse käesoleva määruse II lisa tabeli 4 kohaselt. Rahasummad esitatakse eurodes. Tühistatud tehingud jäetakse esitatavatest andmetest välja. Tehinguid, mille suhtes kohaldatakse avalikustamisega viivitamist, arvestatakse andmeid esitavate üksuste esitatavates koondandmetes täitmise kuupäeva alusel.	Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja	{DECIMAL-18/5}

▼**M3**

Nr	Lahter	Esitatavad andmed	Täitmis- või avalikustamiskoha liik	Aruande vorming ja standardid
7	Tehingu suuruse vahemik	Sellesse lahtrisse märgitakse käesoleva lisa tabelites 3 ja 4 esitatud väärtused. Tehingu suuruse vahemik, nagu on määratletud: lubatud heitkoguste väärtpaberite ja nende tuletisinstrumentide puhul käesoleva lisa tabelis 4; muude instrumentide puhul käesoleva lisa tabelis 3. Kogu päeva peatatud instrumentide puhul selle lahtri ning lahtritega 8 ja 9 seotud andmeid ei esitata.	Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja	{ALPHANUM - -140}
8	Selles vahemikus tehtud tehingute koguarv	Nende täitmise kuupäeval tehtud tehingute koguarv, mille suurus jääb vahemikku. Tühistatud tehingud jäetakse esitatavatest andmetest välja. Tehinguid, mille suhtes kohaldatakse avalikustamisega viivitamist, arvestatakse andmeid esitavate üksuste esitatavates koondandmetes täitmise kuupäeva alusel.	Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja	{INTEGER-18}
9	Selles vahemikus kaubeldud kogumaht	Kaubeldud kogumaht tähistab kõiki aruandepäeval tehtud tehinguid, mille suurus jääb vahemikku. Mahtu mõõdetakse käesoleva määruse II lisa tabeli 4 kohaselt. Rahasummad esitatakse eurodes. Tühistatud tehingud jäetakse esitatavatest andmetest välja. Tehinguid, mille suhtes kohaldatakse avalikustamisega viivitamist, arvestatakse andmeid esitavate üksuste esitatavates koondandmetes täitmise kuupäeva alusel.	Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja	{DECIMAL-18/5}

▼**M3**

Tabel 3

Tehingu suuruse vahemikud võlakirjade, struktureeritud finantstoodete, väärtpaberistatud tuletisinstrumentide, intressimäära tuletisinstrumentide, aktsiatel põhinevate tuletisinstrumentide, välisvaluuta tuletisinstrumentide, krediidituletisinstrumentide, kauba tuletisinstrumentide, C10 tuletisinstrumentide ja hinnavahelepingute puhul

Ulatus	Tehingu suuruse vahemik	Määratlus
Tehingud, mille suurus on vahemikus 0 kuni 1,000,000 (v.a)	]0 – 100,000[	Tehingud, mille suurus on alla 100,000 euro
	[100,000 – 100,000]	Tehingud, mille suurus on võrdne 100,000 euroga
	]100,000 – 200,000[	Tehingud, mille suurus on üle 100,000 euro ja alla 200,000 euro
	[200,000 – 300,000[	Tehingud, mille suurus on üle 200,000 euro või sellega võrdne ja alla 300,000 euro
	[300,000 – 400,000[	Tehingud, mille suurus on üle 300,000 euro või sellega võrdne ja alla 400,000 euro
	[Y – Y + 100,000[	Tehingud, mille suurus on üle Y euro või sellega võrdne ja alla Y + 100,000 euro (100,000 euro suurune samm)
	[900,000 – 1,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle 900,000 euro või sellega võrdne ja alla 1,000,000 euro
Tehingud, mille suurus on vahemikus 1,000,000 (k.a) kuni 10,000,000 (v.a)	[1,000,000 – 1,500,000[	Tehingud, mille suurus on üle 1,000,000 euro või sellega võrdne ja alla 1,500,000 euro
	[1,500,000 – 2,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle 1,500,000 euro või sellega võrdne ja alla 2,000,000 euro
	[Z – Z + 500,000[	Tehingud, mille suurus on üle Z euro või sellega võrdne ja alla Z + 500,000 euro (500,000 euro suurune samm)
	[9,500,000 – 10,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle 9,500,000 euro või sellega võrdne ja alla 10,000,000 euro
Tehingud, mille suurus on vahemikus 10,000,000 (k.a) kuni 100,000,000 (v.a)	[10,000,000 – 15,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle 10,000,000 euro või sellega võrdne ja alla 15,000,000 euro
	[15,000,000 – 20,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle 15,000,000 euro või sellega võrdne ja alla 20,000,000 euro
	[W – W + 5,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle W euro või sellega võrdne ja alla W + 5,000,000 euro (5,000,000 euro suurune samm)
	[95,000,000 – 100,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle 95,000,000 euro või sellega võrdne ja alla 100,000,000 euro
Tehingud, mille suurus on üle 100,000,000 või sellega võrdne	[100,000,000 – 125,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle 100,000,000 euro või sellega võrdne ja alla 125,000,000 euro
	[125,000,000 – 150,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle 125,000,000 euro või sellega võrdne ja alla 150,000,000 euro
	[X – X + 25,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle X euro või sellega võrdne ja alla X + 25,000,000 euro (25,000,000 euro suurune samm)
…	…	…

▼M3

Tabel 4

Tehingu suuruse vahemikud lubatud heitkoguste väärtpaberite ja lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide puhul

Ulatus	Tehingu suuruse vahemik	Määratlus
Tehingud, mille suurus on vahemikus 0 kuni 1,000,000 (v.a)	]0 – 100,000[	Tehingud, mille suurus alla 100,000 CO_2 ekvivalenttonni
	[100,000 – 100,000]	Tehingud, mille suurus on võrdne 100,000 CO_2 ekvivalenttonniga
	]100,000 – 200,000[	Tehingud, mille suurus on üle 100,000 CO_2 ekvivalenttonni ja alla 200,000 CO_2 ekvivalenttonni
	[200,000 – 300,000[	Tehingud, mille suurus on üle 200,000 CO_2 ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 300,000 CO_2 ekvivalenttonni
	[300,000 – 400,000[	Tehingud, mille suurus on üle 300,000 CO_2 ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 400,000 CO_2 ekvivalenttonni
	[Y – Y + 100,000[	Tehingud, mille suurus on üle Y CO_2 ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla Y + 100,000 CO_2 ekvivalenttonni (100,000 CO_2 ekvivalenttonnine samm)
	[900,000 – 1,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle 900,000 CO_2 ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 1,000,000 CO_2 ekvivalenttonni
Tehingud, mille suurus on vahemikus 1,000,000 (k.a) kuni 10,000,000 (v.a)	[1,000,000 – 1,500,000[	Tehingud, mille suurus on üle 1,000,000 CO_2 ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 1,500,000 CO_2 ekvivalenttonni
	[1,500,000 – 2,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle 1,500,000 CO_2 ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 2,000,000 CO_2 ekvivalenttonni
	[Z – Z + 500,000[	Tehingud, mille suurus on üle Z CO_2 ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla Z + 500,000 CO_2 ekvivalenttonni (500,000 CO_2 ekvivalenttonnine samm)
	[9,500,000 – 10,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle 9,500,000 CO_2 ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 10,000,000 CO_2 ekvivalenttonni
Tehingud, mille suurus on vahemikus 10,000,000 (k.a) kuni 100,000,000 (v.a)	[10,000,000 – 15,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle 10,000,000 CO_2 ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 15,000,000 CO_2 ekvivalenttonni
	[15,000,000 – 20,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle 15,000,000 CO_2 ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 20,000,000 CO_2 ekvivalenttonni
	[W – W + 5,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle W CO_2 ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla W + 5,000,000 CO_2 ekvivalenttonni (5,000,000 CO_2 ekvivalenttonnine samm)
	[95,000,000 – 100,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle 95,000,000 CO_2 ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 100,000,000 CO_2 ekvivalenttonni
Tehingud, mille suurus on üle 100,000,000 või sellega võrdne	[100,000,000 – 125,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle 100,000,000 CO_2 ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 125,000,000 CO_2 ekvivalenttonni
	[125,000,000 – 150,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle 125,000,000 CO_2 ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 150,000,000 CO_2 ekvivalenttonni
	[X – X + 25,000,000[	Tehingud, mille suurus on üle X CO_2 ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla X + 25,000,000 CO_2 ekvivalenttonni (25,000,000 CO_2 ekvivalenttonnine samm)
…	…	…