Ovaj je tekst namijenjen isključivo dokumentiranju i nema pravni učinak. Institucije Unije nisu odgovorne za njegov sadržaj. Vjerodostojne inačice relevantnih akata, uključujući njihove preambule, one su koje su objavljene u Službenom listu Europske unije i dostupne u EUR-Lexu. Tim službenim tekstovima može se izravno pristupiti putem poveznica sadržanih u ovom dokumentu.

►B

DELEGIRANA UREDBA KOMISIJE (EU) 2017/583

od 14. srpnja 2016.

o dopuni Uredbe (EU) br. 600/2014 Europskog parlamenta i Vijeća o tržištima financijskih instrumenata u pogledu regulatornih tehničkih standarda u vezi sa zahtjevima u pogledu transparentnosti za mjesta trgovanja i investicijska društva u odnosu na obveznice, strukturirane financijske proizvode, emisijske jedinice i izvedenice

(Tekst značajan za EGP)

(SL L 87, 31.3.2017., str. 229.)

Koju je izmijenila:

		Službeni list		
		br.	stranica	datum
►M1	Delegirana uredba Komisije (EU) 2021/529 od 18. prosinca 2020.	L 106	47	26.3.2021.
►M2	Delegirana uredba Komisije (EU) 2022/629 od 12. siječnja 2022.	L 115I	1	13.4.2022.
►M3	Delegirana uredba Komisije (EU) 2023/945 od 17. siječnja 2023.	L 131	17	16.5.2023.
►M4	Delegirana uredba Komisije (EU) 2025/1246 od 18. lipnja 2025.	L 1246	1	3.11.2025.

Koju je ispravio:

►C1 Ispravak, SL L 90102, 21.11.2023, str. 1 (2023/945)

▼B

DELEGIRANA UREDBA KOMISIJE (EU) 2017/583

od 14. srpnja 2016.

o dopuni Uredbe (EU) br. 600/2014 Europskog parlamenta i Vijeća o tržištima financijskih instrumenata u pogledu regulatornih tehničkih standarda u vezi sa zahtjevima u pogledu transparentnosti za mjesta trgovanja i investicijska društva u odnosu na obveznice, strukturirane financijske proizvode, emisijske jedinice i izvedenice

(Tekst značajan za EGP)

POGLAVLJE I.

DEFINICIJE

▼M4

Članak 1.

Definicije

(članak 9. stavak 5. točka (f) Uredbe (EU) br. 600/2014)

Za potrebe ove Uredbe primjenjuju se sljedeće definicije:

1. „sustav trgovanja koji se temelji na središnjoj knjizi limitiranih naloga” znači bilo što od sljedećeg:

   (a) sustav kontinuiranog trgovanja koji se temelji na knjizi naloga i koji s pomoću knjige naloga i algoritma trgovanja bez ljudske intervencije kontinuirano uparuje naloge za prodaju s nalozima za kupnju na temelju najbolje raspoložive cijene;

   (b) sustav trgovanja koji kombinira elemente sustava kontinuiranog trgovanja koji se temelji na knjizi naloga iz točke (a) i sustava trgovanja koji se temelji na periodičnim dražbama, kako je definiran u točki 2.;

2. „sustav trgovanja koji se temelji na periodičnim dražbama” znači sustav trgovanja koji bez ljudske intervencije uparuje naloge na temelju periodičnih dražbi i algoritma trgovanja.

Članak 1.a

Područje primjene članaka 3., 6., 8., 9., 10., 11. i 13.

1. Članci 3., 6., 9., 10., 11. i 13. primjenjuju se samo na izvedenice. Članak 8. primjenjuje se samo na izvedenice i paketne transakcije.

2. Upućivanja na članak 11. Uredbe (EU) br. 600/2014 u člancima 8. i 11. ove Uredbe trebalo bi tumačiti kao upućivanja na članak 11. Uredbe (EU) br. 600/2014 kako se primjenjivala prije 28. ožujka 2024.

▼B

POGLAVLJE II.

TRANSPARENTNOST PRIJE TRGOVANJA ZA UREĐENA TRŽIŠTA MULTILATERALNE TRGOVINSKE PLATFORME I ORGANIZIRANE TRGOVINSKE PLATFORME

Članak 2.

Obveze u pogledu transparentnosti prije trgovanja

(članak 8. stavci 1. i 2. Uredbe (EU) br. 600/2014)

Tržišni operateri i investicijska društva koji upravljaju mjestom trgovanja objavljuju raspon ponuda cijena za kupnju i prodaju te dubinu trgovinskog interesa po tim cijenama, u skladu s vrstom sustava trgovanja kojim upravljaju i zahtjevima za informacije navedenima u Prilogu I.

Članak 3.

Nalozi velikog tržišnog obujma

(članak 9. stavak 1. točka (a) Uredbe (EU) br. 600/2014)

Nalog ima veliki tržišni obujam u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta ako je, u trenutku unošenja naloga ili nakon njegove izmjene, jednak minimalnoj veličini naloga koja se utvrđuje u skladu s metodologijom iz članka 13. ili veći od te veličine.

▼M4

Članak 3.a

Nalozi velikog tržišnog obujma za obveznice, strukturirane financijske proizvode i emisijske jedinice

(članak 9. stavak 1. točka (a) Uredbe (EU) br. 600/2014)

Nalog koji se odnosi na obveznice, strukturirane financijske proizvode ili emisijske jedinice ima veliki tržišni obujam u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta ako je u trenutku unošenja naloga ili nakon njegove izmjene taj nalog jednak ili veći od sljedećih pragova:

(a) za sve vrste obveznica, osim robe kojom se trguje na burzi („ETC-i”) i dužničkih instrumenata kojima se trguje na burzi („ETN-i”), pragova iz tablice 2.3 u Prilogu III.;

(b) za ETC-e i ETN-e, pragova iz tablice 2.5 u Prilogu III.;

(c) za strukturirane financijske proizvode, pragova iz tablice 3.2 u Prilogu III.;

(d) za emisijske jedinice, pragova iz tablice 12.2 u Prilogu III.

▼B

Članak 4.

Vrsta i minimalna veličina naloga koji su zaprimljeni u sustav za upravljanje nalozima

(članak 9. stavak 1. točka (a) Uredbe (EU) br. 600/2014)

1. Vrsta naloga koji je zaprimljen u sustav za upravljanje nalozima mjesta trgovanja do njegova objavljivanja na tržištu na koji se može primijeniti izuzeće od obveza u pogledu transparentnosti prije trgovanja jest nalog:

(a) koji se namjerava objaviti u knjizi naloga koju vodi mjesto trgovanja i ovisi o objektivnim uvjetima koji su unaprijed definirani protokolima sustava;

(b) koji nije u interakciji s drugim trgovinskim interesima prije objavljivanja u knjizi naloga koju vodi mjesto trgovanja;

(c) koji nakon objavljivanja u knjizi naloga dolazi u interakciju s drugim nalozima u skladu s pravilima koja se primjenjuju na naloge te vrste u trenutku objavljivanja.

2. Minimalna veličina naloga zaprimljenih u sustav za upravljanje nalozima mjesta trgovanja do njihova objavljivanja na tržištu na koje se može primijeniti izuzeće u pogledu obveza transparentnosti prije trgovanja, u trenutku unošenja i nakon izmjena naloga, jedna je od sljedećih:

(a) u slučaju naloga sa skrivenom količinom iznosi 10 000 EUR ili više;

(b) za sve druge naloge veličina veća od minimalne količine kojom se može trgovati ili jednaka toj količini a koju unaprijed utvrđuje operater sustava u skladu sa svojim pravilima i protokolima.

3. Nalog sa skrivenom količinom iz stavka 2. točke (a) smatra se limitiranim nalogom koji se sastoji od objavljenog naloga koji se odnosi na dio određene količine i neobjavljenog naloga koji se odnosi na ostatak količine ako je neobjavljenu količinu moguće izvršiti tek nakon njezina objavljivanja u knjizi naloga kao novog objavljenog naloga.

▼M3

4. Za potrebe stavka 2. točke (a) veličina naloga u sustavu za upravljanje nalozima mjeri se zamišljenim iznosom ugovora kojima se trguje kako je navedeno u Prilogu II. tablici 2. rubrici 10.

▼M4

—————

▼B

Članak 6.

Razredi financijskih instrumenata za koje ne postoji likvidno tržište

(članak 9. stavak 1. točka (c) Uredbe (EU) br. 600/2014)

Smatra se da za financijski instrument ili razred financijskih instrumenata ne postoji likvidno tržište ako je tako utvrđeno u skladu s metodologijom iz članka 13.

▼M4

Članak 6.a

Razredi obveznica, strukturiranih financijskih proizvoda i emisijskih jedinica za koje ne postoji likvidno tržište

(članak 9. stavak 1. točka (c) Uredbe (EU) br. 600/2014)

Kako bi odredila treba li se smatrati da za obveznicu, strukturirani financijski proizvod ili emisijsku jedinicu ne postoji likvidno tržište, nadležna tijela dužna su provesti statično utvrđivanje likvidnosti na temelju sljedećih kriterija:

(a) za sve vrste obveznica, osim ETC-a i ETN-a, kriterija iz tablice 2.2 u Prilogu III.;

(b) za ETC-e i ETN-e, kriterija iz tablice 2.4 u Prilogu III.;

(c) za strukturirane financijske proizvode, kriterija iz tablice 3.1 u Prilogu III.;

(d) za emisijske jedinice, kriterija iz tablice 12.1 u Prilogu III.

▼B

POGLAVLJE III.

TRANSPARENTNOST POSLIJE TRGOVANJA ZA MJESTA TRGOVANJA I INVESTICIJSKA DRUŠTVA KOJA TRGUJU IZVAN MJESTA TRGOVANJA

Članak 7.

Obveze u pogledu transparentnosti poslije trgovanja

(članak 10. stavak 1. i članak 21. stavci 1. i 5. Uredbe (EU) br. 600/2014)

1. Investicijska društva koja ne trguju u skladu s pravilima mjesta trgovanja te tržišni operateri i investicijska društva koji upravljaju mjestom trgovanja objavljuju za svaku transakciju pojedinosti utvrđene u tablicama 1. i 2. Priloga II. i upotrebljavaju odgovarajuće oznake iz tablice 3. Priloga II.

▼M4

U objavljenim nazivima rubrika iz tablice 2 u Prilogu II. moraju se poštovati konvencije imenovanja iz naziva rubrike u toj tablici.

▼B

2. Ako je prethodno objavljeno izvješće o trgovanju poništeno, investicijska društva koja trguju izvan mjesta trgovanja te tržišni operateri i investicijska društva koji upravljaju mjestom trgovanja objavljuju novo izvješće o trgovanju koje sadržava sve pojedinosti iz izvornog izvješća o trgovanju te oznaku za poništenje utvrđenu u tablici 3. Priloga II.

3. Ako je prethodno objavljeno izvješće o trgovanju izmijenjeno, investicijska društva koja trguju izvan mjesta trgovanja te tržišni operateri i investicijska društva koji upravljaju mjestom trgovanja objavljuju sljedeće informacije:

(a) novo izvješće o trgovanju koje sadržava sve pojedinosti iz izvornog izvješća o trgovanju te oznaku za poništenje utvrđenu u tablici 3. Priloga II.;

(b) novo izvješće o trgovanju koje sadržava sve pojedinosti iz izvornog izvješća o trgovanju u kojem su ispravljene sve potrebne pojedinosti te oznaku za izmjenu utvrđenu u tablici 3. Priloga II.

▼M4

4. Informacije poslije trgovanja objavljuju se što bliže stvarnom vremenu, a u svakom slučaju u roku od pet minuta od izvršenja relevantne transakcije.

_____

▼B

7. Investicijska društva poduzimaju sve razumne mjere kako bi osigurala da se transakcija objavi kao jedinstvena transakcija. U tu se svrhu dvije podudarajuće transakcije koje su sklopljene istodobno i po jednakoj cijeni uz posredovanje jedne ugovorne strane smatraju jedinstvenom transakcijom.

▼M4

8. Informacije koje se odnose na paketnu transakciju uključuju oznaku paketne transakcije ili oznaku transakcije razmjene za fizička sredstva iz tablice 3 u Prilogu II. Ako paketna transakcija ispunjava uvjete za odgođeno objavljivanje na temelju članka 8., nakon isteka razdoblja odgode za transakciju moraju se staviti na raspolaganje informacije o svim njezinim sastavnicama.

▼B

Članak 8.

Odgođeno objavljivanje transakcija

(članak 11. stavci 1. i 3. i članak 21. stavak 4. Uredbe (EU) br. 600/2014)

1. Ako nadležno tijelo odobri odgođeno objavljivanje pojedinosti o transakcijama u skladu s člankom 11. stavkom 1. Uredbe (EU) br. 600/2014, investicijska društva koja trguju izvan mjesta trgovanja te tržišni operateri i investicijska društva koji upravljaju mjestom trgovanja objavljuju sve transakcije najkasnije u 19:00 sati po lokalnom vremenu drugog radnog dana od datuma transakcije, pod uvjetom da je ispunjen jedan od sljedećih uvjeta:

(a) transakcija ima veliki tržišni obujam u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta kako je utvrđeno u članku 9.;

▼B

(b) transakcija se odnosi na financijski instrument ili razred financijskih instrumenata za koji ne postoji likvidno tržište kako je utvrđeno u skladu s metodologijom iz članka 13.;

(c) transakcija se izvršava između investicijskog društva koje trguje za vlastiti račun osim na temelju uparivanja naloga u skladu s člankom 4. stavkom 1. točkom 38. Direktive 2014/65/EU Europskog parlamenta i Vijeća ([1]) i druge ugovorne strane te premašuje veličinu karakterističnu za instrument kako je navedeno u članku 10.;

(d) transakcija je paketna transakcija koja ispunjuje jedan od sljedećih kriterija:

i. jedna ili više njezinih sastavnica jesu transakcije financijskim instrumentima za koje ne postoji likvidno tržište;

ii. jedna ili više njezinih sastavnica jesu transakcije financijskim instrumentima koje imaju veliki tržišni obujam u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta kako je utvrđeno u članku 9.;

iii. transakcija se izvršava između investicijskog društva koje trguje za vlastiti račun osim na temelju uparivanja naloga u skladu s člankom 4. stavkom 1. točkom 38. Direktive 2014/65/EU i druge ugovorne strane, a jedna ili više njezinih sastavnica jesu transakcije financijskim instrumentima koje premašuju veličinu karakterističnu za instrument kako je utvrđeno u članku 10.

2. Nakon što rok za odgodu iz stavka 1. prestane važiti, objavljuju se sve pojedinosti o transakciji osim ako je u skladu s člankom 11. odobreno produženo ili neodređeno razdoblje odgode.

3. Ako se transakcija između dvaju investicijskih društava, za vlastiti račun ili za račun klijenta, ne izvršava u skladu s pravilima mjesta trgovanja, nadležno tijelo za potrebe utvrđivanja primjenjivog režima odgode nadležno je tijelo investicijskog društva odgovornog za objavljivanje transakcije putem APA-e u skladu s člankom 7. stavcima 5. 6. i 7.

▼M4

Članak 8.a

Odgođeno objavljivanje transakcija obveznicama, strukturiranim financijskim proizvodima i emisijskim jedinicama

(članak 11. Uredbe (EU) br. 600/2014)

1. Tržišni operateri i investicijska društva koji upravljaju mjestom trgovanja te investicijska društva koja trguju izvan mjesta trgovanja mogu odgoditi objavu pojedinosti o transakcijama koje se odnose na obveznice, osim ETC-a i ETN-a, u skladu sa sljedećim:

([1]) Direktiva 2014/65/EU Europskog parlamenta i Vijeća od 15. svibnja 2014. o tržištu financijskih instrumenata i izmjeni Direktive 2002/92/EZ i Direktive 2011/61/EU (SL L 173, 12.6.2014., str. 349.).

▼M4

(a) odgoda objave cijene i odgoda objave volumena od najviše 15 minuta za transakcije kategorije 1 iz tablice 2.6 u Prilogu III.;

(b) odgoda objave cijene i odgoda objave volumena najviše do kraja dana trgovanja za transakcije kategorije 2 iz tablice 2.6 u Prilogu III.;

(c) odgoda objave cijene najviše do kraja prvog dana trgovanja nakon datuma transakcije i odgoda objave volumena od najviše tjedan dana nakon datuma transakcije, za transakcije kategorije 3 iz tablice 2.6 u Prilogu III.;

(d) odgoda objave cijene najviše do kraja drugog dana trgovanja nakon datuma transakcije i odgoda objave volumena od najviše dva tjedna nakon datuma transakcije, za transakcije kategorije 4 iz tablice 2.6 u Prilogu III.;

(e) odgoda objave cijene i odgoda objave volumena od najviše četiri tjedna nakon datuma transakcije, za transakcije kategorije 5 iz tablice 2.6 u Prilogu III.

2. Tržišni operateri i investicijska društva koji upravljaju mjestom trgovanja te investicijska društva koja trguju izvan mjesta trgovanja mogu odgoditi objavu pojedinosti o transakcijama koje se odnose na ETC-e, ETN-e i strukturirane financijske proizvode, u skladu sa sljedećim:

(a) odgoda objave cijene najviše do kraja drugog dana trgovanja nakon datuma transakcije, za transakcije bilo koje veličine; i

(b) odgoda objave volumena od najviše dva tjedna nakon datuma transakcije, za transakcije bilo koje veličine.

3. Tržišni operateri i investicijska društva koji upravljaju mjestom trgovanja te investicijska društva koja trguju izvan mjesta trgovanja dužni su objaviti svaku transakciju emisijskim jedinicama najkasnije u 19:00 sati po lokalnom vremenu drugog radnog dana nakon datuma transakcije, pod uvjetom da je transakcija veća od veličine poslije trgovanja navedene za emisijske jedinice u tablici 12.2. u Prilogu III.

▼B

Članak 9.

Transakcije velikog tržišnog obujma

(članak 11. stavak 1. točka (a) Uredbe (EU) br. 600/2014)

Smatra se da transakcija ima veliki tržišni obujam u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta ako je jednaka minimalnoj veličini transakcije ili veća od nje, pri čemu se ta veličina izračunava u skladu s metodologijom iz članka 13.

▼B

Članak 10.

Veličina karakteristična za financijski instrument

(članak 11. stavak 1. točka (c) Uredbe (EU) br. 600/2014)

Smatra se da transakcija premašuje veličinu karakterističnu za financijski instrument ako je jednaka minimalnoj veličini transakcije ili veća od nje, pri čemu se ta veličina izračunava u skladu s metodologijom iz članka 13.

Članak 11.

Zahtjevi u pogledu transparentnosti u vezi s odgođenim objavljivanjem koje odobravaju nadležna tijela

(članak 11. stavak 3. Uredbe (EU) br. 600/2014)

1. Ako nadležna tijela izvršavaju svoje ovlasti u vezi s odobravanjem odgođenog objavljivanja u skladu s člankom 11. stavkom 3. Uredbe (EU) br. 600/2014, primjenjuje se sljedeće:

(a) ako se primjenjuje članak 11. stavak 3. točka (a) Uredbe (EU) br. 600/2014, nadležna tijela zahtijevaju objavu bilo koje od sljedećih informacija tijekom cijelog razdoblja odgode kako je utvrđeno u članku 8.:

i. svih pojedinosti o transakciji utvrđenih u tablicama 1. i 2. Priloga II. uz iznimku pojedinosti koje se odnose na volumen;

ii. transakcije u zbirnom obliku po danu za najmanje pet transakcija izvršenih istoga dana, koje se objavljuju sljedećeg radnog dana prije 9:00 sati po lokalnom vremenu.

(b) ako se primjenjuje članak 11. stavak 3. točka (b) Uredbe (EU) br. 600/2014, nadležna tijela dopuštaju da se volumen pojedinačne transakcije ne objavi tijekom produženog razdoblja od četiri tjedna.

(c) u pogledu nevlasničkih instrumenata koji nisu državni dužnički instrumenti i ako se primjenjuje članak 11. stavak 3. točka (c) Uredbe (EU) br. 600/2014, nadležna tijela dopuštaju da se tijekom produženog razdoblja odgode od četiri tjedna nekoliko transakcija izvršenih tijekom jednog kalendarskog tjedna objavi u zbirnom obliku sljedećeg utorka prije 9:00 sati po lokalnom vremenu.

▼M4

_____

▼B

2. Ako je produženo razdoblje odgode iz stavka 1. točke (b) prestalo važiti, primjenjuju se sljedeći uvjeti:

(a) u pogledu svih instrumenata koji nisu državni dužnički instrumenti, sve pojedinosti o svim pojedinačnim transakcijama objavljuju se sljedećeg radnog dana prije 9:00 sati po lokalnom vremenu.

▼M4

_____

▼B

3. U pogledu svih instrumenata koji nisu državni dužnički instrumenti, sve pojedinosti o transakcijama na pojedinačnoj osnovi objavljuju se četiri tjedna od objave pojedinosti u zbirnom obliku u skladu sa stavkom 1. točkom (c) prije 9:00 sati po lokalnom vremenu.

▼M4

4. Dnevni ili tjedni podaci u zbirnom obliku iz stavaka 1. i 2. moraju sadržavati sljedeće informacije o izvedenicama za svaki dan ili tjedan predmetnog kalendarskog razdoblja:

(a) ponderiranu prosječnu cijenu;

(b) ukupni volumen trgovanja kako je naveden u tablici 4 u Prilogu II.;

(c) ukupni broj transakcija.

▼B

5. Transakcije se objedinjavaju prema oznaci ISIN. Ako oznaka ISIN nije dostupna, transakcije se objedinjavaju na razini razreda financijskih instrumenata na koji se primjenjuje test likvidnosti iz članka 13.

▼M4

6. Ako dan u tjednu predviđen za objave iz stavka 1. točke (c) te stavaka 2. i 3. nije radni dan, podaci se objavljuju sljedeći radni dan prije 09:00 sati po lokalnom vremenu.

Članak 11.a

Zahtjevi u pogledu transparentnosti za državne dužničke instrumente u vezi s odgođenim objavljivanjem koje odobravaju nadležna tijela

(članak 11. stavak 3. Uredbe (EU) br. 600/2014)

1. Objava pojedinosti o različitim transakcijama u zbirnom obliku u skladu s člankom 11. stavkom 3. točkom (b) Uredbe (EU) br. 600/2014 obuhvaća transakcije koje su izvršene tijekom jednog kalendarskog tjedna i provodi se sljedećeg utorka prije 09:00 sati po lokalnom vremenu.

2. Tjedni podaci u zbirnom obliku iz stavka 1. moraju sadržavati sljedeće informacije za svaki tjedan predmetnog kalendarskog razdoblja:

(a) ponderiranu prosječnu cijenu;

(b) ukupni volumen trgovanja kako je naveden u tablici 4 u Prilogu II.;

(c) ukupni broj transakcija.

3. Transakcije se agregiraju prema oznaci ISIN.

4. Ako dan u tjednu predviđen za objave iz stavka 1. nije radni dan, podaci se objavljuju sljedeći radni dan prije 09:00 sati po lokalnom vremenu.

▼M3

Članak 12.

Primjena obveze transparentnosti poslije trgovanja na određene transakcije izvršene izvan mjesta trgovanja

(Članak 21. stavak 1. Uredbe (EU) br. 600/2014)

Obveze utvrđene u članku 21. stavku 1. Uredbe (EU) br. 600/2014 ne primjenjuju se na transakcije navedene u članku 2. stavku 5. Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/590 ([1]).

▼B

POGLAVLJE IV.

ZAJEDNIČKE ODREDBE ZA TRANSPARENTNOST PRIJE TRGOVANJA I POSLIJE TRGOVANJA

Članak 13.

Metodologija za izračun transparentnosti

(članak 9. stavci 1. i 2., članak 11. stavak 1. i članak 22. stavak 1. Uredbe (EU) br. 600/2014)

1. Za utvrđivanje financijskih instrumenata ili razreda financijskih instrumenata za koje ne postoji likvidno tržište za potrebe članka 6. i članka 8. stavka 1. točke (b) primjenjuju se sljedeće metodologije u svim razredima imovine:

(a) statično utvrđivanje likvidnosti za:

i. razred imovine sekuritiziranih izvedenica kako je definirano u tablici 4.1. Priloga III.;

ii. sljedeće podrazrede imovine vlasničkih izvedenica: opcije na dioničke indekse, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na dioničke indekse, opcije na dionice, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na dionice, opcije na dividendu dionice, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na dividendu dionice, opcije na indeks dividendi, budućnosnice/terminski ugovori koje se odnose na indeks dividendi, opcije na indeks volatilnosti, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na indeks volatilnosti, opcije na fondove čijim se udjelima trguje na burzi, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na fondove čijim se udjelima trguje na burzi i druge vlasničke izvedenice kako je definirano u tablici 6.1. Priloga III.;

iii. razred imovine valutnih izvedenica kako je definirano u tablici 8.1. Priloga III.;

▼M4

iv. podrazrede imovine druge kamatne izvedenice, druge robne izvedenice, druge kreditne izvedenice, druge C10 izvedenice, drugi ugovori za razlike (CFD-i) i druge izvedenice na emisijske jedinice iz tablica 5.1, 7.1, 9.1, 10.1, 11.1 i 13.1 u Prilogu III.

([1]) Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/590 od 28. srpnja 2016. o dopuni Uredbe (EU) br. 600/2014 Europskog parlamenta i Vijeća u pogledu regulatornih tehničkih standarda za izvješćivanje nadležnih tijela o transakcijama (SL L 87, 31.3.2017., str. 449.).

▼B

(b) periodička procjena na temelju kvantitativnih i, ako je primjenjivo, kvalitativnih kriterija likvidnosti za:

▼M4

_____

▼B

iii. razred imovine kamatnih izvedenica osim podrazreda imovine drugih kamatnih izvedenica kako je definirano u tablici 5.1. Priloga III.;

iv. sljedeće podrazrede imovine vlasničkih izvedenica: ugovori o razmjeni i ugovori o razmjeni na razini portfelja kako je definirano u tablici 6.1. Priloga III.;

v. razred imovine robnih izvedenica osim podrazreda imovine drugih robnih izvedenica kako je definirano u tablici 7.1. Priloga III.;

vi. sljedeće podrazrede imovine kreditnih izvedenica: indeksni ugovori o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza i ugovori o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza jednog subjekta kako je definirano u tablici 9.1. Priloga III.;

vii. razred imovine C10 izvedenica osim podrazreda imovine drugih C10 izvedenica kako je definirano u tablici 10.1. Priloga III.;

viii. sljedeće podrazrede imovine ugovora za razlike (CFD): valutni CFD-ovi i robni CFD-ovi kako je definirano u tablici 11.1. Priloga III.;

▼M4

_____

▼B

x. razred imovine izvedenica emisijskih jedinica osim podrazreda imovine drugih izvedenica emisijskih jedinica kako je definirano u tablici 13.1. Priloga III.;

(c) periodička procjena na temelju kvalitativnih kriterija likvidnosti za:

i. sljedeće podrazrede imovine kreditnih izvedenica: opcije na indeks CDS-ova i opcije na CDS jednog subjekta kako je definirano u tablici 9.1. Priloga III.;

ii. sljedeće podrazrede imovine ugovora za razlike (CFD): vlasnički CFD-ovi, CFD-ovi koji se odnose na obveznice, CFD-ovi koji se odnose na vlasničke budućnosnice/terminske ugovore i CFD-ovi koji se odnose na vlasničke opcije kako je definirano u tablici 11.1. Priloga III.

▼M4

_____

▼B

2. ►M4 Kako bi se utvrdilo imaju li nalozi veliki tržišni obujam u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta u smislu članka 3., primjenjuju se sljedeće metodologije: ◄

(a) granična vrijednost za:

▼M4

_____

▼B

ii. razred imovine sekuritiziranih izvedenica kako je definirano u tablici 4.2. Priloga III.;

iii. sve podrazrede vlasničkih izvedenica kako je definirano u tablicama 6.2. i 6.3. Priloga III.;

iv. sve podrazrede valutnih izvedenica kako je definirano u tablici 8.2. Priloga III.;

v. sve podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u pogledu razreda imovine kamatnih izvedenica, robnih izvedenica, kreditnih izvedenica, C10 izvedenica i ugovora za razlike (CFD) kako je definirano u tablicama 5.3., 7.3., 9.3., 10.3. i 11.3. Priloga III.;

▼M4

vi. sve podrazrede imovine za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište, za razred imovine izvedenice na emisijske jedinice u skladu s tablicom 13.3. u Prilogu III.

_____

▼B

(b) ►M4 veličina transakcije ispod koje se nalazi postotak transakcija koji odgovara percentilu trgovanja ili donji prag, ovisno o tome koja je vrijednost veća, za: ◄

▼M4

_____

▼B

ii. sve podrazrede s likvidnim tržištem za razrede imovine kamatnih izvedenica, robnih izvedenica, kreditnih izvedenica, C10 izvedenica i ugovora za razlike (CFD) kako je definirano u tablicama 5.2., 7.2., 9.2., 10.2. i 11.2. Priloga III.;

▼M4

iii. sve podrazrede imovine za koje postoji likvidno tržište, za razred imovine izvedenice na emisijske jedinice u skladu s tablicom 13.2 u Prilogu III.;

_____

▼B

3. Za utvrđivanje veličine karakteristične za financijski instrument iz članka 8. stavka 1. točke (c) i za transakcije velikog tržišnog obujma u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta iz članka 8. stavka 1. točke (a) primjenjuju se sljedeće metodologije:

(a) granična vrijednost za:

▼M4

_____

▼B

ii. razred imovine sekuritiziranih izvedenica kako je definirano u tablici 4.2. Priloga III.;

iii. sve podrazrede vlasničkih izvedenica kako je definirano u tablicama 6.2. i 6.3. Priloga III.;

iv. sve podrazrede valutnih izvedenica kako je definirano u tablici 8.2. Priloga III.;

v. sve podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u pogledu razreda imovine kamatnih izvedenica, robnih izvedenica, kreditnih izvedenica, C10 izvedenica i ugovora za razlike (CFD) kako je definirano u tablicama 5.3., 7.3., 9.3., 10.3. i 11.3. Priloga III.;

▼M4

vi. sve podrazrede imovine za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište, za razred imovine izvedenice na emisijske jedinice u skladu s tablicom 13.3 u Prilogu III.;

_____

_____

▼B

(c) veličina transakcije ispod koje se nalazi postotak transakcija koja odgovara percentilu trgovanja, veličina transakcije ispod koje se nalazi postotak volumena koja odgovara percentilu volumena i granična vrijednost, ovisno o tome koja je vrijednost najveća, za sve podrazrede za koje se smatra da imaju likvidno tržište u pogledu razreda imovine kamatnih izvedenica, robnih izvedenica, kreditnih izvedenica, C10 izvedenica i ugovora za razlike (CFD-ova) kako je predviđeno u tablicama 5.2., 7.2., 9.2., 10.2. i 11.2. Priloga III.;

▼M4

(d) veličina transakcije ispod koje se nalazi postotak transakcija koji odgovara percentilu trgovanja ili donji prag, ovisno o tome koja je vrijednost veća, za sve podrazrede imovine za koje se smatra da postoji likvidno tržište, za izvedenice na emisijske jedinice u skladu s tablicom 13.2 u Prilogu III.

▼B

4. Za potrebe stavka 3. točke (c), ako je veličina transakcije koja odgovara percentilu volumena za utvrđivanje transakcije koja ima veliki tržišni obujam u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta veća od 97,5 percentila trgovanja, volumen trgovanja ne uzima se u obzir, a veličina karakteristična za financijski instrument iz članka 8. stavka 1. točke (c) i veličina transakcija velikog tržišnog obujma u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta iz članka 8. stavka 1. točke (a) utvrđuju se kao veličina transakcije ispod koje se nalazi postotak transakcija koja odgovara percentilu trgovanja i granična vrijednost, ovisno o tome koja je vrijednost veća.

▼B

5. U skladu s Delegiranom uredbom (EU) 2017/590 i Delegiranom uredbom (EU) 2017/577 nadležna tijela od mjesta trgovanja, APA-a i CTP-ova svakodnevno prikupljaju podatke koji su potrebni za izvršavanje izračuna za utvrđivanje:

(a) financijskih instrumenata i razreda financijskih instrumenata za koje ne postoji likvidno tržište kako je utvrđeno u stavku 1.;

▼M4

(b) veličine velikog tržišnog obujma u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta i veličine karakteristične za instrument kako je utvrđena u stavku 3.

▼M3

Podaci iz prvog podstavka prikupljaju se u skladu s Prilogom V.

▼B

6. Nadležna tijela koja provode izračune za razred financijskih instrumenata utvrđuju aranžmane za međusobnu suradnju kako bi se osiguralo objedinjavanje podataka u Uniji koji su potrebni za izračune.

▼M4

7. Za potrebe stavka 1. točke (b), stavka 2. točke (b) i stavka 3. točaka (c) i (d) nadležna tijela uzimaju u obzir transakcije izvršene u Uniji između 1. siječnja i 31. prosinca prethodne godine.

8. Veličina transakcije za potrebe stavka 2. točke (b) i stavka 3. točaka (c) i (d) utvrđuje se na temelju mjere volumena iz tablice 4 u Prilogu II. Ako je veličina transakcije utvrđena za potrebe stavaka 2. i 3. izražena u monetarnoj vrijednosti, a financijski instrument nije denominiran u eurima, veličina transakcije preračunava se u valutu financijskog instrumenta primjenom referentnog tečaja za euro Europske središnje banke od 31. prosinca prethodne godine.

▼B

9. Tržišni operateri i investicijska društva koji upravljaju mjestom trgovanja mogu veličine transakcija utvrđene u skladu sa stavcima 2. i 3. preračunati u odgovarajući broj jedinica koje je unaprijed odredilo to mjesto trgovanja za predmetni podrazred ili podrazred imovine. Tržišni operateri i investicijska društva koji upravljaju mjestom trgovanja mogu primjenjivati te veličine transakcije sve do primjene rezultata sljedećih izračuna koji se provode u skladu sa stavkom 17.

▼M4

_____

11. Za potrebe utvrđivanja iz stavaka 2. i 3., kad god je broj transakcija koje se uzimaju u obzir za izračun manji od 1 000, ne primjenjuju se stavak 2. točka (b) i stavak 3. točke (c) i (d). U tim se slučajevima umjesto toga primjenjuju granične vrijednosti navedene u stavku 2. točki (a) i stavku 3. točki (a).

▼B

12. ►M4 Osim ako je riječ o izvedenicama na emisijske jedinice, izračuni iz stavka 2. točke (b) i stavka 3. točke (c) zaokružuju se na sljedeće iznose: ◄

(a) 100 000 ako granična vrijednost iznosi manje od 1 milijun;

(b) 500 000 ako granična vrijednost iznosi 1 milijun ili više, ali manje od 10 milijuna;

(c) 5 milijuna ako granična vrijednost iznosi 10 milijuna ili više, ali manje od 100 milijuna;

(d) 25 milijuna ako granična vrijednost iznosi 100 milijuna ili više.

13. Za potrebe stavka 1. kvantitativni kriteriji likvidnosti navedeni za svaki razred imovine u Prilogu III. utvrđuju se u skladu s odjeljkom 1. Priloga III.

▼M4

14. Za vlasničke izvedenice koje su uvrštene za trgovanje ili se njima prvi put trguje na mjestu trgovanja, a koje ne pripadaju podrazredu za koji su objavljene veličina karakteristična za financijski instrument iz članka 8. stavka 1. točke (c) te veličina naloga i transakcija velikog tržišnog obujma u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta iz članka 3. i članka 8. stavka 1. točke (a) te koje pripadaju jednom od podrazreda imovine navedenih u stavku 1. točki (a) podtočki ii., veličina karakteristična za financijski instrument i veličina naloga i transakcija velikog tržišnog obujma u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta jesu veličine koje su primjenjive na kategoriju najmanjeg prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) podrazreda imovine kojem pripada vlasnička izvedenica.

15. Za financijske instrumente koji su uvršteni za trgovanje ili se njima prvi put trguje na mjestu trgovanja, a koji ne pripadaju podrazredu za koji su objavljene veličina karakteristična za financijski instrument iz članka 8. stavka 1. točke (c) te veličina naloga i transakcija velikog tržišnog obujma u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta iz članka 3. i članka 8. stavka 1. točke (a), smatra se da ne postoji likvidno tržište sve do primjene rezultata izračuna provedenih u skladu sa stavkom 17. Primjenjiva veličina karakteristična za financijski instrument iz članka 8. stavka 1. točke (c) te veličina naloga i transakcija velikog tržišnog obujma u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta iz članka 3. i članka 8. stavka 1. točke (a) jesu veličine podrazreda za koje je utvrđeno da nemaju likvidno tržište koji pripadaju istom podrazredu imovine.

▼B

16. Nakon završetka dana trgovanja, ali prije kraja tog dana, mjesta trgovanja nadležnim tijelima dostavljaju pojedinosti uključene u Prilog IV. za provedbu izračuna iz stavka 5. kad god se financijski instrument uvrštava za trgovanje ili se njime prvi put trguje na tom mjestu trgovanja ili kad god se izmijene prethodno dostavljene pojedinosti.

▼M3

17. Nadležna tijela osiguravaju da se rezultati izračuna iz stavka 5. za svaki financijski instrument i razred financijskog instrumenta objave do 30. travnja godine od datuma početka primjene Uredbe (EU) br. 600/2014 i do 30. travnja svake sljedeće godine. Rezultati izračuna primjenjuju se od prvog ponedjeljka u lipnju svake godine nakon objave do dana prije prvog ponedjeljka u lipnju sljedeće godine.

▼M4

_____

▼B

Članak 14.

Transakcije na koje se primjenjuje izuzeće iz članka 1. stavka 6. Uredbe (EU) br. 600/2014

(članak 1. stavak 6. Uredbe (EU) br. 600/2014)

Smatra se da je član Europskog sustava središnjih banaka (ESSB) sklopio transakciju u okviru provedbe monetarne politike, devizne politike i politike financijske stabilnosti ako ta transakcija ispunjava sljedeće uvjete:

(a) transakcija se izvršava za potrebe monetarne politike, uključujući operaciju koja se izvršava u skladu s člancima 18. i 20. Statuta Europskog sustava središnjih banaka i Europske središnje banke koji je priložen Ugovoru o Europskoj uniji ili operaciju koja se izvršava u okviru jednakovrijednih nacionalnih odredbi za članove ESSB-a u državama članicama čija valuta nije euro;

(b) transakcija je devizna operacija, uključujući operacije koje se izvršavaju radi držanja službenih valutnih pričuva država članica ili upravljanja njima ili uslugu upravljanja pričuvama koju pruža član ESSB-a središnjim bankama u drugim zemljama za koje je razdoblje odgode produljeno u skladu s člankom 1. stavkom 9. Uredbe (EU) br. 600/2014.;

(c) transakcija se izvršava za potrebe politike financijske stabilnosti.

Članak 15.

Transakcije na koje se ne primjenjuje izuzeće iz članka 1. stavka 6. Uredbe (EU) br. 600/2014

(članak 1. stavak 7. Uredbe (EU) br. 600/2014)

Članak 1. stavak 6. Uredbe (EU) br. 600/2014 ne primjenjuje se na sljedeće vrste transakcija koje je sklopio član ESSB-a radi izvršenja operacije ulaganja koja nije povezana s izvršavanjem jednog od zadataka iz članka 14. od strane tog člana:

(a) transakcije koje se sklapaju radi upravljanja kapitalom;

▼B

(b) transakcije koje se sklapaju u administrativne svrhe ili za potrebe osoblja člana ESSB-a, a uključuju transakcije koje se sklapaju u svojstvu upravitelja mirovinskog sustava za osoblje;

(c) transakcije koje član sklapa za potrebe portfelja ulaganja u skladu s obvezama u okviru nacionalnog prava.

▼M4

Članak 16.

Privremena suspenzija obveza u pogledu transparentnosti

(članak 9. stavak 4. Uredbe (EU) br. 600/2014)

1. Za financijske instrumente za koje postoji likvidno tržište, kako je utvrđeno u skladu s metodologijom iz članka 6.a za obveznice, strukturirane financijske proizvode i emisijske jedinice odnosno iz članka 13. za izvedenice, nadležna tijela mogu privremeno suspendirati obveze utvrđene u člancima 8., 8.a i 10. Uredbe (EU) br. 600/2014 ako za razred obveznica, strukturiranih financijskih proizvoda, emisijskih jedinica ili izvedenica ukupni volumen iz tablice 4 u Prilogu II. izračunan za prethodnih 30 kalendarskih dana čini manje od 40 % prosječnog mjesečnog volumena izračunanog za punih 12 kalendarskih mjeseci prije tih 30 kalendarskih dana.

2. Za financijske instrumente za koje ne postoji likvidno tržište, kako je utvrđeno u skladu s metodologijom iz članka 6.a za obveznice, strukturirane financijske proizvode i emisijske jedinice odnosno iz članka 13. za izvedenice, nadležna tijela mogu privremeno suspendirati obveze utvrđene u člancima 8., 8.a i 10. Uredbe (EU) br. 600/2014 ako za razred obveznica, strukturiranih financijskih proizvoda, emisijskih jedinica ili izvedenica ukupni volumen iz tablice 4 u Prilogu II. izračunan za prethodnih 30 kalendarskih dana čini manje od 20 % prosječnog mjesečnog volumena izračunanog za punih 12 kalendarskih mjeseci prije tih 30 kalendarskih dana.

3. U izračunima iz stavaka 1. i 2. nadležna tijela uzimaju u obzir transakcije izvršene na svim mjestima trgovanja u Uniji za predmetni razred obveznica, strukturiranih financijskih proizvoda, emisijskih jedinica ili izvedenica. Nadležna tijela dužna su provesti te izračune na razini razreda financijskih instrumenata na koje se primjenjuje test likvidnosti iz članka 6.a za obveznice, strukturirane financijske proizvode i emisijske jedinice odnosno iz članka 13. za izvedenice.

4. Prije nego što suspendiraju obveze u pogledu transparentnosti, nadležna tijela dužna su provjeriti da značajno smanjenje likvidnosti na svim mjestima trgovanja nije posljedica sezonskih učinaka relevantnog razreda financijskih instrumenata na likvidnost.

▼B

Članak 19.

Stupanje na snagu i primjena

Ova Uredba stupa na snagu dvadesetog dana od dana objave u *Službenom listu Europske unije*.

Primjenjuje se od 3. siječnja 2018.

Ova je Uredba u cijelosti obvezujuća i izravno se primjenjuje u svim državama članicama.

▼M4

PRILOG I.

Vrste sustava i povezane informacije koje treba objaviti u skladu s člankom 2.

Vrsta sustava	Informacije koje treba objaviti
Sustav kontinuiranog trgovanja koji se temelji na knjizi naloga	Za svaki financijski instrument, ukupni broj naloga i volumen koji ti nalozi predstavljaju na svakoj cjenovnoj razini za najmanje pet najboljih kupovnih i prodajnih cijena.
Sustav trgovanja koji se temelji na periodičnim dražbama	Za svaki financijski instrument, cijena koja bi najbolje odražavala algoritam trgovanja sustava koji se temelji na dražbama i volumen koji sudionici u tom sustavu potencijalno mogu izvršiti po toj cijeni.

▼B

PRILOG II.

Pojedinosti o transakcijama koje se stavljaju na raspolaganje javnosti

Tablica 1.

Tablica s oznakama za tablicu 2.

OZNAKA	VRSTA PODATKA	DEFINICIJA
{ALPHANUM-n}	Do n alfanumeričkih znakova	Rubrika za slobodan unos teksta.
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerička znaka	Troslovna oznaka države, kako je definirano u valutnim oznakama u skladu s normom ISO 4217
{DATE_TIME_FORMAT}	Format datuma i vremena u skladu s normom ISO 8601	Datum i vrijeme u sljedećem formatu: GGGG-MM-DDTss:mm:ss.dddddddZ. pri čemu je: — „GGGG” je godina; — „MM” je mjesec; — „DD” je dan; — „T” – znači da se upotrebljava slovo „T” — „ss” je sat; — „mm” je minuta; — „ss.dddddd” je sekunda i dio sekunde; — Z je UTC vrijeme. Datumi i vremena navode se u UTC formatu.
{DECIMAL-n/m}	Decimalni broj od ukupno najviše n znamenki od kojih najviše m znamenki može biti dio decimale	Numeričko polje za pozitivne i negativne vrijednosti. — decimalni razdjelnik je „.” (točka); — negativni znakovi imaju predznak „–” (minus); Vrijednosti se, prema potrebi, zaokružuju, a ne skraćuju.
{ISIN}	12 alfanumerička znaka	Oznaka ISIN, kako je definirano u normi ISO 6166
{MIC}	4 alfanumerička znaka	Identifikacijska oznaka tržišta, kako je definirano u normi ISO 10383

▼M4

Tablica 2.

Popis pojedinosti za potrebe transparentnosti poslije trgovanja

Objavljeni nazivi rubrika (zaglavlja stupaca) moraju biti jednaki nazivu rubrike iz tablice 2.

Br.	Naziv rubrike	Financijski instrumenti	Opis i pojedinosti za objavu	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format koji se koristi u skladu s tablicom 1
1	Datum i vrijeme trgovanja	Za sve financijske instrumente	Datum i vrijeme izvršenja transakcije. Za transakcije izvršene na mjestu trgovanja razina granularnosti mora biti u skladu sa zahtjevima iz članka 12. Delegirane uredbe Komisije (EU) 2025/1155 ([1]) Za transakcije koje nisu izvršene na mjestu trgovanja navodi se datum i vrijeme kad su strane dogovorile sadržaj sljedećih rubrika: količina, cijena, valute, u skladu s rubrikama 31, 34 i 44 tablice 2 u Prilogu I. Delegiranoj uredbi (EU) 2017/590, identifikacijska oznaka instrumenta, razvrstavanje instrumenata i oznaka odnosnog instrumenta, ako je primjenjivo. Za transakcije koje nisu izvršene na mjestu trgovanja razina granularnosti navedenog vremena mora biti barem najbliža sekunda. Ako je transakcija izvršena na temelju naloga koji je društvo koje ga izvršava prenijelo trećoj strani u ime klijenta, a nisu ispunjeni uvjeti za prijenos iz članka 4. Delegirane uredbe (EU) 2017/590, navodi se datum i vrijeme same transakcije, a ne vrijeme prijenosa naloga.	Uređeno tržište (RM) Multilateralna trgovinska platforma (MTP) Organizirana trgovinska platforma (OTP) Ovlašteni sustav objavljivanja (APA)	{DATE_TIME_ FORMAT}
2	Identifikacijska oznaka instrumenta	Za sve financijske instrumente	Oznaka za identifikaciju financijskog instrumenta	RM, MTP, OTP, APA	{ISIN}

▼M4

Br.	Naziv rubrike	Financijski instrumenti	Opis i pojedinosti za objavu	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format koji se koristi u skladu s tablicom 1
3	Cijena	Za sve financijske instrumente	Cijena izvršenja transakcije, koja ne uključuje eventualnu proviziju i obračunane kamate. Cijena izvršenja transakcije navodi se u skladu sa standardnom tržišnom konvencijom. Vrijednost navedena u ovoj rubrici mora odgovarati vrijednosti navedenoj u rubrici „Oznaka cijene”. Ako cijena trenutačno nije dostupna, ali će to postati („PNDG”), ili nije primjenjiva („NOAP”), ova se rubrika ne ispunjava.	RM, MTP, OTP, APA	{DECIMAL-18/13} ako je cijena izražena u monetarnoj vrijednosti {DECIMAL-11/10} ako je cijena izražena u postotku ili prinosu {DECIMAL-18/17} ako je cijena izražena u baznim bodovima
4	Nedostajuća cijena	Za sve financijske instrumente	Ako cijena trenutačno nije dostupna, ali će to postati, vrijednost je „PNDG”. Ako cijena nije primjenjiva, vrijednost je „NOAP”.	RM, MTP, OTP, APA	„PNDG” ako cijena nije dostupna „NOAP” ako cijena nije primjenjiva
5	Valuta cijene	Za sve financijske instrumente	Glavna valuta u kojoj je cijena izražena (primjenjivo ako je cijena izražena u monetarnoj vrijednosti).	RM, MTP, OTP, APA	{CURRENCY CODE_3}
6	Oznaka cijene	Za sve financijske instrumente	Informacija o tome izražava li se cijena u monetarnoj vrijednosti, postotku, baznim bodovima ili prinosu. Oznaka cijene navodi se u skladu sa standardnom tržišnom konvencijom. Za ugovore o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza u ovoj rubrici navodi se „BAPO”. Za obveznice (osim ETN-a i ETC-a) u ovoj se rubrici navodi postotak (PERC) zamišljenog iznosa. Ako cijena izražena u postotku nije u skladu sa standardnom tržišnom konvencijom, navodi se „YIEL”, „BAPO” ili „MONE”, u skladu sa standardnom tržišnom konvencijom. Vrijednost navedena u ovoj rubrici mora odgovarati vrijednosti navedenoj u rubrici „Cijena”. Ako je cijena izražena u monetarnoj vrijednosti, navodi se u glavnoj valutnoj jedinici.	RM, MTP, OTP, APA	„MONE” – monetarna vrijednost „PERC” – postotak „YIEL” – prinos „BAPO” – bazni bodovi

▼M4

Br.	Naziv rubrike	Financijski instrumenti	Opis i pojedinosti za objavu	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format koji se koristi u skladu s tablicom 1
			Ako cijena trenutačno nije dostupna, ali će to postati („PNDG”), ili nije primjenjiva („NOAP”), ova se rubrika ne ispunjava.		
7	Količina	Za sve financijske instrumente, osim u slučajevima opisanima u članku 11. stavku 1. točkama (a) i (b) ove Uredbe.	Za financijske instrumente kojima se trguje u jedinicama, broj jedinica tog financijskog instrumenta. U protivnom se ostavlja prazno.	RM, MTP, OTP, APA	{DECIMAL-18/17}
8	Količina izražena u mjernoj jedinici	Za ugovore o robnim izvedenicama koji se odnose na jedinice, C10 izvedenice, izvedenice na emisijske jedinice i emisijske jedinice, osim u slučajevima opisanima u članku 11. stavku 1. točkama (a) i (b) ove Uredbe	Jednakovrijedna količina robe ili emisijskih jedinica kojima se trguje izražena u mjernoj jedinici.	RM, MTP, OTP, APA	{DECIMAL-18/17}
9	Oznaka količine izražene u mjernoj jedinici	Za ugovore o robnim izvedenicama koji se odnose na jedinice, C10 izvedenice, izvedenice na emisijske jedinice i emisijske jedinice, osim u slučajevima opisanima u članku 11. stavku 1. točkama (a) i (b) ove Uredbe	Oznaka mjerne jedinice u kojoj je izražena količina.	RM, MTP, OTP, APA	„TOCD” – tone ekvivalenta ugljikova dioksida, za svaki ugovor koji se odnosi na emisijske jedinice „TONE” – metričke tone „MWHO” – megavatsati „MBTU” – milijun britanskih toplinskih jedinica „THMS” – termovi „DAYS” – dani ili {ALPHANUM-4} neka druga jedinica

▼M4

Br.	Naziv rubrike	Financijski instrumenti	Opis i pojedinosti za objavu	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format koji se koristi u skladu s tablicom 1
10	Zamišljeni iznos	Za sve financijske instrumente, osim u slučajevima opisanima u članku 11. stavku 1. točkama (a) i (b) ove Uredbe	U ovoj se rubrici navodi: i. za obveznice (ne uključujući ETC-e i ETN-e), nominalna vrijednost, što je iznos isplaćen ulagatelju pri otkupu; ii. za ETC-e, ETN-e i sekuritizirane izvedenice, broj instrumenata koje su kupci i prodavatelji razmijenili pomnožen s cijenom instrumenta razmijenjenog u toj određenoj transakciji, što je jednako umnošku polja s cijenom i polja s količinom; iii. za strukturirane financijske proizvode (SFP-i), jedinična nominalna vrijednost pomnožena s brojem instrumenata u vrijeme transakcije; iv. za ugovore o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza, zamišljeni iznos za koji se stječe ili prodaje zaštita; v. za opcije, opcije razmjene, ugovore o razmjeni osim onih iz točke iv., budućnosnice i terminske ugovore, zamišljeni iznos ugovora; vi. za emisijske jedinice, iznos koji se u vrijeme transakcije dobije za određenu količinu po relevantnoj cijeni utvrđenoj ugovorom, što je jednako umnošku polja s cijenom i polja s količinom izraženom u mjernoj jedinici; vii. za oklade na raspone, monetarna vrijednost uloga po promjeni boda u odnosnom financijskom instrumentu u vrijeme transakcije;	RM, MTP, OTP, APA	{DECIMAL-18/5}

▼M4

Br.	Naziv rubrike	Financijski instrumenti	Opis i pojedinosti za objavu	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format koji se koristi u skladu s tablicom 1
			viii. za ugovore za razlike (CFD), broj instrumenata koje su kupci i prodavatelji razmijenili pomnožen s cijenom instrumenta razmijenjenog u toj određenoj transakciji, što je jednako umnošku polja s cijenom i polja s količinom.		
11	Valuta zamišljenog iznosa	Za sve financijske instrumente, osim u slučajevima opisanima u članku 11. stavku 1. točkama (a) i (b) ove Uredbe	Glavna valuta u kojoj se iskazuje zamišljeni iznos. U slučaju ugovora o valutnoj izvedenici, viševalutnog ugovora o razmjeni ili opcije razmjene u kojoj je odnosni ugovor o razmjeni viševalutni ili valutni CFD ili ugovor o okladama na raspone riječ je o valuti zamišljenog iznosa jednog dijela ugovora.	RM, MTP, OTP, APA	{CURRENCY CODE_3}
12	[izbrisano]				
13	Mjesto izvršenja	Za sve financijske instrumente	Identifikacija mjesta izvršenja transakcije. Za transakcije izvršene na mjestu trgovanja u EU-u navodi se oznaka MIC segmenta u skladu s normom ISO 10383. Ako oznaka MIC segmenta ne postoji, navodi se operativni MIC. Za financijske instrumente uvrštene za trgovanje ili kojima se trguje na mjestu trgovanja navodi se oznaka „SINT” ako se transakcija tim financijskim instrumentom izvršava putem sistematskog internalizatora. Za financijske instrumente uvrštene za trgovanje ili kojima se trguje na mjestu trgovanja navodi se oznaka MIC „XOFF” ako se transakcija tim financijskim instrumentom ne izvršava na mjestu trgovanja u EU-u ni putem sistematskog internalizatora. Ako se transakcija izvršava na organiziranoj trgovinskoj platformi izvan EU-a, uz oznaku „XOFF” mora se ispuniti i rubrika „Mjesto trgovanja u trećoj zemlji na kojem je transakcija izvršena”.	RM, MTP, OTP, APA	{MIC} – mjesta trgovanja u EU-u ili „SINT” – sistematski internalizator „XOFF” – nešto drugo

▼M4

Br.	Naziv rubrike	Financijski instrumenti	Opis i pojedinosti za objavu	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format koji se koristi u skladu s tablicom 1
14	Mjesto trgovanja u trećoj zemlji na kojem je transakcija izvršena	Za sve financijske instrumente	Identifikacija mjesta trgovanja u trećoj zemlji na kojem je transakcija izvršena. Navodi se oznaka MIC segmenta u skladu s normom ISO 10383. Ako oznaka MIC segmenta ne postoji, koristi se operativni MIC. Ako transakcija nije izvršena na mjestu trgovanja u trećoj zemlji, rubrika se ne ispunjava.	APA	{MIC}
15	Datum i vrijeme objave	Za sve financijske instrumente	Datum i vrijeme kad su mjesto trgovanja ili APA objavili transakciju. Za transakcije izvršene na mjestu trgovanja razina granularnosti mora biti u skladu sa zahtjevima iz članka 12. Delegirane uredbe (EU) 2025/1155. Za transakcije koje nisu izvršene na mjestu trgovanja razina granularnosti navedenog vremena mora biti barem najbliža sekunda.	RM, MTP, OTP, APA	{DATE_TIME_ FORMAT}
16	Mjesto objave	Za sve financijske instrumente	Oznaka za identifikaciju mjesta trgovanja i APA-a koji su objavili transakciju.	RM, MTP, OTP, APA	{MIC}
17	Identifikacijska oznaka transakcije	Za sve financijske instrumente	Alfanumerička oznaka koju dodjeljuju mjesta trgovanja (u skladu s člankom 12. Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/580 ([2])) i APA-i te koja se navodi pri svakom daljnjem upućivanju na konkretnu transakciju.	RM, MTP, OTP, APA	{ALPHA NUMERICAL-52}
18	Transakcija se poravnava	Za izvedenice	Označuje hoće li se transakcija poravnati.	RM, MTP, OTP, APA	„TRUE” – transakcija se poravnava „FALSE” – transakcija se ne poravnava

▼M4

Br.	Naziv rubrike	Financijski instrumenti	Opis i pojedinosti za objavu	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format koji se koristi u skladu s tablicom 1
19	Oznake	Za sve financijske instrumente	Jednu ili više rubrika treba ispuniti primjenjivim oznakama u skladu s tablicom 3 u Prilogu II. Ako se ne primjenjuje nijedna od navedenih okolnosti, transakciju treba objaviti bez oznake. Ako je moguća kombinacija oznaka i ona se navodi u jednoj rubrici, oznake treba odvojiti zarezima.	RM, MTP, OTP, APA	U skladu s tablicom 3 u Prilogu II.
20	Sustav trgovanja	Za sve financijske instrumente	Vrsta sustava trgovanja u kojem je transakcija izvršena. Ako je u rubrici „Mjesto izvršenja” navedeno „SINT” ili „XOFF”, ova se rubrika ne ispunjava.	RM, MTP, OTP	„CLOB” – sustav trgovanja koji se temelji na središnjoj knjizi limitiranih naloga. „QDTS” – sustav trgovanja koji se temelji na ponudama, odnosno sustav u kojem se transakcije zaključuju na temelju obvezujućih ponuda koje su sudionicima neprekidno na raspolaganju i koji od održavatelja tržišta zahtijeva održavanje ponuda na razini kojom se postiže ravnoteža između potreba članova i sudionika za trgovanjem na komercijalnoj razini i rizika kojem se održavatelj tržišta izlaže. „PATS” – sustav trgovanja koji se temelji na periodičnim dražbama. „RFQT” – sustav trgovanja koji se temelji na zahtjevima za ponude, odnosno sustav trgovanja u kojem se ponude dostavljaju na temelju zahtjeva za ponude koji je podnio jedan ili više drugih članova ili sudionika. Ponudu može izvršiti isključivo član ili sudionik na tržištu koji je podnio zahtjev. Član ili sudionik koji je podnio zahtjev može zaključiti transakciju prihvaćanjem ponude ili ponuda koje su mu dostavljene na zahtjev.

▼M4

Br.	Naziv rubrike	Financijski instrumenti	Opis i pojedinosti za objavu	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format koji se koristi u skladu s tablicom 1
					„VOIC” – sustav glasovnog trgovanja, odnosno sustav trgovanja u kojem članovi transakcije dogovaraju glasovnim pregovaranjem. „HYBR” – hibridni sustav trgovanja, odnosno sustav koji se može svrstati u dvije ili više navedenih vrsta sustava trgovanja. „OTHR” – bilo koji drugi sustav trgovanja, odnosno bilo koja druga vrsta sustava trgovanja koja nije prethodno navedena.
21	Broj transakcija	Za državne dužničke instrumente	U ovoj rubrici treba navesti broj transakcija izvršenih kad se zahtijeva odgođeno objavljivanje pojedinosti o različitim transakcijama u zbirnom obliku u skladu s člankom 11. stavkom 3. točkom (b) Uredbe (EU) br. 600/2014.	RM, MTP, OTP, APA	{DECIMAL-18/17}

([1]) Delegirana uredba Komisije (EU) 2025/1155 od 12. lipnja 2025. o dopuni Uredbe (EU) br. 600/2014 Europskog parlamenta i Vijeća u pogledu regulatornih tehničkih standarda kojima se određuju ulazni i izlazni podaci za konsolidirane podatke, usklađivanje satova poslovanja i preraspodjela prihoda koju provodi pružatelj konsolidiranih podataka za dionice i ETF-ove i o stavljanju izvan snage Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/574 (SL L, 2025/1155, 3.11.2027., ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2025/1155/oj).

([2]) Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/580 od 24. lipnja 2016. o dopuni Uredbe (EU) br. 600/2014 Europskog parlamenta i Vijeća u pogledu regulatornih tehničkih standarda za evidentiranje relevantnih podataka u vezi s nalozima koji se odnose na financijske instrumente (SL L 87, 31.3.2017., str. 193., ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/580/oj).

▼M4

Tablica 3.

Popis oznaka za potrebe transparentnosti poslije trgovanja

OZNAKE ZA ODGODU OBJAVE PODATAKA O IZVEDENICAMA POSLIJE TRGOVANJA

Oznaka	Naziv	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Opis
„LRGS”	Oznaka transakcije velikog tržišnog obujma (LIS) poslije trgovanja	RM, MTP, OTP, APA	Transakcije izvršene uz odgodu objave zbog velikog tržišnog obujma poslije trgovanja.
„ILQD”	Oznaka transakcije nelikvidnim instrumentom	RM, MTP, OTP, APA	Transakcije izvršene uz odgodu objave jer se odnose na instrumente za koje ne postoji likvidno tržište.
„SIZE”	Oznaka transakcije koja premašuje veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) poslije trgovanja	RM, MTP, OTP, APA	Transakcije izvršene uz odgodu objave jer premašuju veličinu karakterističnu za instrument poslije trgovanja.

OZNAKE ZA ODGODU OBJAVE PODATAKA O OBVEZNICAMA (OSIM ETC-a I ETN-a) POSLIJE TRGOVANJA

Oznaka	Naziv	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Opis
MLF1	Oznaka srednje velike transakcije za koju postoji likvidno tržište	RM, MTP, OTP, APA	Transakcije obveznicama na koje se primjenjuje odgoda objave za srednje velike transakcije financijskim instrumentima za koje postoji likvidno tržište u skladu s člankom 8.a stavkom 1. točkom (a) ove Uredbe.
MIF2	Oznaka srednje velike transakcije za koju ne postoji likvidno tržište	RM, MTP, OTP, APA	Transakcije obveznicama na koje se primjenjuje odgoda objave za srednje velike transakcije financijskim instrumentima za koje ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 8.a stavkom 1. točkom (b) ove Uredbe.
LLF3	Oznaka velike transakcije za koju postoji likvidno tržište	RM, MTP, OTP, APA	Transakcije obveznicama na koje se primjenjuje odgoda objave za velike transakcije financijskim instrumentima za koje postoji likvidno tržište u skladu s člankom 8.a stavkom 1. točkom (c) ove Uredbe.
LIF4	Oznaka velike transakcije za koju ne postoji likvidno tržište	RM, MTP, OTP, APA	Transakcije obveznicama na koje se primjenjuje odgoda objave za velike transakcije financijskim instrumentima za koje ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 8.a stavkom 1. točkom (d) ove Uredbe.

▼M4

OZNAKE ZA ODGODU OBJAVE PODATAKA O OBVEZNICAMA (OSIM ETC-a I ETN-a) POSLIJE TRGOVANJA

Oznaka	Naziv	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Opis
VLF5	Oznaka vrlo velike transakcije za koju postoji likvidno tržište	RM, MTP, OTP, APA	Transakcije obveznicama na koje se primjenjuje odgoda objave za vrlo velike transakcije financijskim instrumentima za koje postoji likvidno tržište u skladu s člankom 8.a stavkom 1. točkom (e) ove Uredbe.
VIF5	Oznaka vrlo velike transakcije za koju ne postoji likvidno tržište	RM, MTP, OTP, APA	Transakcije obveznicama na koje se primjenjuje odgoda objave za vrlo velike transakcije financijskim instrumentima za koje ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 8.a stavkom 1. točkom (e) ove Uredbe.

OZNAKE ZA ODGODU OBJAVE PODATAKA O ETC-ima, ETN-ima, SFP-ima I EMISIJSKIM JEDINICAMA POSLIJE TRGOVANJA

Oznaka	Naziv	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Opis
DEFF	Odgoda objave podataka o ETC-ima, ETN-ima, SFP-ima i emisijskim jedinicama	RM, MTP, OTP, APA	Transakcije ETC-ima, ETN-ima, SFP-ima i emisijskim jedinicama na koje se primjenjuje odgoda objave iz članka 8.a stavaka 2. i 3. ove Uredbe.

OZNAKE ZA DODATNU ODGODU OBJAVE PODATAKA O IZVEDENICAMA

Članak 11. stavak 1. točka (a) podtočka i.	„LMTF”	Oznaka za ograničene pojedinosti	RM, MTP, OTP, APA	Prvo izvješće s objavom ograničenih pojedinosti u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (a) podtočkom i.
	„FULF”	Oznaka za potpune pojedinosti	RM, MTP, OTP, APA	Transakcija za koju su prethodno objavljene ograničene pojedinosti u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (a) podtočkom i.
Članak 11. stavak 1. točka (a) podtočka ii.	„DATF”	Oznaka transakcije za koju se pojedinosti objavljuju u zbirnom obliku po danu	RM, MTP, OTP, APA	Objava transakcija za koje se pojedinosti objavljuju u zbirnom obliku po danu u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (a) podtočkom ii.
	„FULA”	Oznaka za potpune pojedinosti	RM, MTP, OTP, APA	Pojedinačne transakcije za koje su pojedinosti prethodno objavljene u zbirnom obliku u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (a) podtočkom ii.

▼M4

OZNAKE ZA DODATNU ODGODU OBJAVE PODATAKA O IZVEDENICAMA				
Članak 11. stavak 1. točka (b)	„VOLO”	Oznaka za izostavljanje volumena	RM, MTP, OTP, APA	Transakcija za koju se objavljuju ograničene pojedinosti u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (b).
	„FULV”	Oznaka za potpune pojedinosti	RM, MTP, OTP, APA	Transakcija za koju su prethodno objavljene ograničene pojedinosti u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (b).
Članak 11. stavak 1. točka (c)	„FWAF”	Oznaka za objavu u zbirnom obliku za razdoblje od četiri tjedna	RM, MTP, OTP, APA	Objava transakcija za koje se pojedinosti objavljuju u zbirnom obliku u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (c).
	„FULJ”	Oznaka za potpune pojedinosti	RM, MTP, OTP, APA	Pojedinačne transakcije za koje su pojedinosti prethodno objavljene u zbirnom obliku u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (c).

OZNAKE ZA DODATNU ODGODU OBJAVE PODATAKA O DRŽAVNIM OBVEZNICAMA				
Članak 11. stavak 3. točka (a)	„OMIS”	Oznaka za izostavljanje volumena	RM, MTP, OTP, APA	Transakcija za koju se objavljuju ograničene pojedinosti u skladu s člankom 11. stavkom 3. točkom (a) Uredbe (EU) br. 600/2014.
	„FULO”	Oznaka za potpune pojedinosti	RM, MTP, OTP, APA	Transakcija za koju su prethodno objavljene ograničene pojedinosti u skladu s člankom 11. stavkom 3. točkom (a) Uredbe (EU) br. 600/2014.
Članak 11. stavak 3. točka (b)	„AGFW”	Oznaka za objavu u zbirnom obliku za razdoblje od četiri tjedna	RM, MTP, OTP, APA	Objava transakcija za koje se pojedinosti objavljuju u zbirnom obliku u skladu s člankom 11. stavkom 3. točkom (b) Uredbe (EU) br. 600/2014.
	„FULG”	Oznaka za potpune pojedinosti	RM, MTP, OTP, APA	Pojedinačne transakcije za koje su pojedinosti prethodno objavljene u zbirnom obliku u skladu s člankom 11. stavkom 3. točkom (b) Uredbe (EU) br. 600/2014.

DRUGE OZNAKE

Oznaka	Naziv	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Opis
„BENC”	Oznaka transakcije koja se temelji na referentnoj vrijednosti	RM, MTP, OTP, APA	Transakcije izvršene na temelju cijene koja se izračunava u više navrata u skladu s određenom referentnom vrijednošću, kao što je prosječna cijena ponderirana volumenom ili vremenski ponderirana prosječna cijena.
„NPFT”	Oznaka transakcije koja ne doprinosi formiranju cijena	RM, MTP, OTP, APA	Transakcije koje ne doprinose formiranju cijena u skladu s člankom 2. stavkom 5. Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/590.

▼M4

DRUGE OZNAKE

Oznaka	Naziv	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Opis
„TPAC”	Oznaka paketne transakcije	RM, MTP, OTP, APA	Paketne transakcije koje nisu razmjena za fizička sredstva kako je definirana u članku 2. stavku 1. točki 50. podtočki (b) Uredbe (EU) br. 600/2014.
„XFPH”	Oznaka transakcije razmjene za fizička sredstva	RM, MTP, OTP, APA	Razmjena za fizička sredstva kako je definirana u članku 2. stavku 1. točki 48. Uredbe (EU) br. 600/2014.
„CANC”	Oznaka za poništenje	RM, MTP, OTP, APA	Upotrebljava se ako je prethodno objavljena transakcija poništena.
„AMND”	Oznaka za izmjenu	RM, MTP, OTP, APA	Upotrebljava se ako je prethodno objavljena transakcija izmijenjena.
„PORT”	Oznaka za portfeljno trgovanje	RM, MTP, OTP, APA	Transakcije s pet ili više različitih financijskih instrumenata kojima istodobno trguje isti klijent po jedinstvenoj cijeni za cijelu grupu, koje nisu „paketne transakcije” kako su definirane u članku 2. stavku 1. točki 50. Uredbe (EU) br. 600/2014.
„MTCH”	Oznaka trgovanja za vlastiti račun uparivanjem naloga	OTP	Trgovanje za vlastiti račun uparivanjem naloga u skladu s člankom 4. stavkom 1. točkom 38. Direktive 2014/65/EU.
„NEGO”	Oznaka dogovorene transakcije	RM, MTP, OTP	Transakcije koje su dogovorene privatno, ali se o njima izvješćuje u skladu s pravilima mjesta trgovanja.

▼M3

Tablica 4

Mjera volumena

Vrsta instrumenta	Volumen
Sve obveznice osim ETC-a i ETN-a i strukturirani financijski proizvodi	„Zamišljeni iznos” ugovora kojim se trguje prema rubrici 10 u tablici 2 Priloga II. ovoj Uredbi.
Vrste obveznica – ETC-i i ETN-i	„Zamišljeni iznos” ugovora kojim se trguje prema rubrici 10 u tablici 2 Priloga II. ovoj Uredbi.
Sekuritizirane izvedenice	„Zamišljeni iznos” ugovora kojim se trguje prema rubrici 10 u tablici 2 Priloga II. ovoj Uredbi.
Kamatne izvedenice	„Zamišljeni iznos” ugovora kojim se trguje prema rubrici 10 u tablici 2 Priloga II. ovoj Uredbi.
Valutne izvedenice	„Zamišljeni iznos” ugovora kojim se trguje prema rubrici 10 u tablici 2 Priloga II. ovoj Uredbi.
Vlasničke izvedenice	„Zamišljeni iznos” ugovora kojim se trguje prema rubrici 10 u tablici 2 Priloga II. ovoj Uredbi.
Robne izvedenice	„Zamišljeni iznos” ugovora kojim se trguje prema rubrici 10 u tablici 2 Priloga II. ovoj Uredbi.
Kreditne izvedenice	„Zamišljeni iznos” ugovora kojim se trguje prema rubrici 10 u tablici 2 Priloga II. ovoj Uredbi.
Ugovori za razlike	„Zamišljeni iznos” ugovora kojim se trguje prema rubrici 10 u tablici 2 Priloga II. ovoj Uredbi.
C10 izvedenice	„Zamišljeni iznos” ugovora kojim se trguje prema rubrici 10 u tablici 2 Priloga II. ovoj Uredbi.
Izvedenice na emisijske jedinice	„Količina iskazana u mjernoj jedinici” prema rubrici 8 u tablici 2 Priloga II. ovoj Uredbi.
Emisijske jedinice	„Količina iskazana u mjernoj jedinici” prema rubrici 8 u tablici 2 Priloga II. ovoj Uredbi.

▼B

PRILOG III.

Ocjena likvidnosti, pragovi za veliki tržišni obujam (LIS) i veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) za nevlasničke financijske instrumente

▼M4

1. **Upute za potrebe ovog Priloga**

1. Upućivanje na nepodmireni iznos izdanih obveznica u tablici 2.2 odnosi se na ukupnu vrijednost izdanih obveznica koje ulagatelji trenutačno drže.

2. Upućivanje na „razred imovine” znači upućivanje na sljedeće razrede financijskih instrumenata: obveznice, strukturirane financijske proizvode, sekuritizirane izvedenice, kamatne izvedenice, vlasničke izvedenice, robne izvedenice, valutne izvedenice, kreditne izvedenice, C10 izvedenice, CFD-e, emisijske jedinice i izvedenice na emisijske jedinice.

3. Upućivanje na „podrazred imovine” znači upućivanje na razred imovine koji je detaljnije segmentiran na temelju vrste ugovora i/ili vrste odnosne imovine.

4. Upućivanje na „podrazred” znači upućivanje na podrazred imovine koji je detaljnije segmentiran na temelju dodatnih kvalitativnih kriterija segmentacije iz tablica od 2.2 do 13.3 ovog Priloga.

5. „Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)” znači ukupni zamišljeni iznos za određeni financijski instrument, utvrđen u skladu s mjerom volumena iz tablice 4 u Prilogu II. i izvršen u razdoblju iz članka 13. stavka 7., podijeljen s brojem dana trgovanja u tom razdoblju ili, ako je primjenjivo, onom dijelu godine u kojem je financijski instrument bio uvršten za trgovanje ili se njime trgovalo na mjestu trgovanja i u kojem nije bio suspendiran iz trgovanja.

6. „Prosječni dnevni broj transakcija” znači ukupni broj transakcija izvršen za određeni financijski instrument u razdoblju iz članka 13. stavka 7., podijeljen s brojem dana trgovanja u tom razdoblju ili, ako je primjenjivo, onom dijelu godine u kojem je financijski instrument bio uvršten za trgovanje ili se njime trgovalo na mjestu trgovanja i u kojem nije bio suspendiran iz trgovanja.

7. „Budućnosnica” znači ugovor o kupnji ili prodaji robe ili financijskog instrumenta na određeni budući datum po cijeni koju su kupac i prodavatelj dogovorili pri sklapanju ugovora. Svaka budućnosnica ima standardne odredbe kojima se utvrđuju minimalna količina i kvaliteta koja se može kupiti ili prodati, najmanji iznos za koji se može promijeniti cijena, postupci za isporuku, datum dospijeća i ostala obilježja povezana s ugovorom.

8. „Opcija” znači ugovor kojim vlasnik stječe pravo, ali nema obvezu, kupnje (engl. *call*) ili prodaje (engl. *put*) određenog financijskog instrumenta ili robe po unaprijed utvrđenoj cijeni ili izvršnoj cijeni, na određeni budući datum ili datum izvršenja odnosno do tog datuma.

9. „Ugovor o razmjeni” znači ugovor kojim se dvije strane dogovaraju da će na određeni budući datum razmijeniti novčane tokove iz jednog financijskog instrumenta za novčane tokove iz drugog financijskog instrumenta.

10. „Ugovor o razmjeni na razini portfelja” znači ugovor na temelju kojeg krajnji korisnici mogu trgovati većim brojem ugovora o razmjeni.

▼**M4**

11. „Terminski ugovor” znači privatni dogovor između dvije strane o kupnji ili prodaji robe ili financijskog instrumenta na određeni budući datum po cijeni koju su kupac i prodavatelj dogovorili pri sklapanju ugovora.

12. „Opcija razmjene” ili „opcija koja se odnosi na ugovor o razmjeni” znači ugovor kojim vlasnik stječe pravo, ali nema obvezu, sklapanja ugovora o razmjeni na određeni budući datum ili datum izvršenja odnosno do tog datuma.

13. „Budućnosnica koja se odnosi na ugovor o razmjeni” znači budućnosnica kojom vlasnik stječe obvezu sklapanja ugovora o razmjeni na određeni budući datum ili do tog datuma.

14. „Terminski ugovor koji se odnosi na ugovor o razmjeni” znači terminski ugovor kojim vlasnik stječe obvezu sklapanja ugovora o razmjeni na određeni budući datum ili do tog datuma.

▼M4

2. **Obveznice**

Tablica 2.2.

Obveznice (sve vrste osim ETC-a i ETN-a) – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Za svaku se pojedinu obveznicu smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6.a ako ima jednu od posebnih kombinacija obilježja navedenih u recima tablice u nastavku.

Državne i druge javne obveznice						
Identifikacijska oznaka grupe	**Identifikacijska oznaka iz MiFIR-a**	**Vrsta obveznice**	**Izdavatelj ili zemlja izdavatelj**	**Preostali rok do dospijeća**	**Vrsta kupona**	**Nepodmireni iznos izdanih obveznica**
	RTS2#3	RTS2#9	Zemlja izdavatelja navedena u rubrici Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/585 ([1]) („RTS23”) „Identifikator izdavatelja ili operatera mjesta trgovanja”	Preostalo vrijeme do datuma dospijeća navedeno u rubrici RTS-a 23 „Datum dospijeća”	Treće slovo oznake CFI navedene u rubrici RTS-a 23 „Razvrstavanje instrumenata”	Rubrika RTS-a 23 „Ukupni izdani nominalni iznos”, preračunano u EUR
G1	BOND	EUSB EUSB znači obveznica koja nije ni konvertibilna ni pokrivena obveznica i koju je izdao državni izdavatelj: (a) Unija; (b) država članica, uključujući ministarstvo, agenciju ili subjekt posebne namjene države članice; (c) u slučaju države članice s federalnim uređenjem, neka od saveznih članica; (d) subjekt posebne namjene za nekoliko država članica; (e) međunarodna financijska institucija koju su osnovale dvije ili više država članica, čija je svrha mobilizirati sredstva i pružiti financijsku pomoć članovima koji imaju ili im prijete ozbiljne financijske poteškoće; (f) Europska investicijska banka; (g) državni subjekt treće zemlje.	Zemlja izdavatelj je država članica, Sjedinjene Američke Države ili Ujedinjena Kraljevina; ILI izdavatelj je Unija.	Najviše 10 godina	F (fiksni kupon)	Manje od 5 000 000 000 EUR
G2	BOND	EUSB ili OEPB OEPB znači obveznica koja nije ni konvertibilna ni pokrivena obveznica i koju je izdalo javno tijelo koje nije državni izdavatelj.	Svaki instrument koji nije naveden pod G1			Manje od 1 000 000 000 EUR

([1]) Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/585 od 14. srpnja 2016. o dopuni Uredbe (EU) br. 600/2014 Europskog parlamenta i Vijeća u pogledu regulatornih tehničkih standarda za standarde i formate podataka za referentne podatke o financijskom instrumentu i tehničke mjere u odnosu na aranžmane koje trebaju uvesti Europsko nadzorno tijelo za vrijednosne papire i tržišta kapitala i nadležna tijela (SL L 87, 31.3.2017., str. 368., ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/585/oj).

▼M4

Korporativne, konvertibilne i druge obveznice					
Identifikacijska oznaka grupe	**Identifikacijska oznaka iz MiFIR-a**	**Vrsta obveznice**	**Valuta**	**Kreditni rejting**	**Nepodmireni iznos izdanih obveznica**
	RTS2#3	RTS2#9	Valuta instrumenta navedena u rubrici RTS-a 23 „Valuta zamišljene vrijednosti 1”		Rubrika RTS-a 23 „Ukupni izdani nominalni iznos”, preračunano u EUR
G3	BOND	CRPB, CVTB ili OTHR CRPB znači obveznica koja nije ni konvertibilna ni pokrivena obveznica i koju je izdalo europsko dioničko društvo (*Societas Europaea*) osnovano u skladu s Uredbom Vijeća (EZ) br. 2157/2001 ([1]) ili vrsta poduzeća iz Priloga I. ili Priloga II. Direktivi 2013/34/EU Europskog parlamenta i Vijeća ([2]) ili ekvivalentno poduzeće u trećim zemljama. CVTB znači instrument koji se sastoji od obveznice ili sekuritiziranog dužničkog instrumenta s ugrađenom izvedenicom, npr. opcijom kupnje odnosnog vlasničkog instrumenta.	EUR, GBP, USD	Investicijski rejting	Manje od 500 000 000 EUR
G4	BOND	CRPB, CVTB ili OTHR	Svaki instrument koji nije naveden pod G3		Manje od 500 000 000 EUR

([1]) Uredba Vijeća (EZ) br. 2157/2001 od 8. listopada 2001. o Statutu europskog društva (SE) (SL L 294, 10.11.2001., str. 1., ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2001/2157/oj).
([2]) Direktiva 2013/34/EU Europskog parlamenta i Vijeća od 26. lipnja 2013. o godišnjim financijskim izvještajima, konsolidiranim financijskim izvještajima i povezanim izvješćima za određene vrste poduzeća, o izmjeni Direktive 2006/43/EZ Europskog parlamenta i Vijeća i o stavljanju izvan snage direktiva Vijeća 78/660/EEZ i 83/349/EEZ (SL L 182, 29.6.2013., str. 19., ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2013/34/oj).

Pokrivene obveznice			
Identifikacijska oznaka grupe	**Identifikacijska oznaka iz MiFIR-a**	**Vrsta obveznice**	**Nepodmireni iznos izdanih obveznica**
	RTS2#3	RTS2#9	Rubrika RTS-a 23 „Ukupni izdani nominalni iznos”, preračunano u EUR
G5	BOND	CVDB CVDB znači obveznice iz članka 52. stavka 4. Direktive 2009/65/EZ Europskog parlamenta i Vijeća ([1]).	Manje od 500 000 000 EUR

([1]) Direktiva 2009/65/EZ Europskog parlamenta i Vijeća od 13. srpnja 2009. o usklađivanju zakona i drugih propisa u odnosu na subjekte za zajednička ulaganja u prenosive vrijednosne papire (UCITS) (SL L 302, 17.11.2009., str. 32., ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2009/65/oj).

▼M4

Tablica 2.3.

Obveznice (sve vrste osim ETC-a i ETN-a) – pragovi za LIS prije trgovanja

Razred imovine – obveznice (sve vrste osim ETC-a i ETN-a)	
Vrsta obveznice	**LIS prije trgovanja**
Državne i druge javne obveznice	5 000 000 EUR
Korporativne, konvertibilne i druge obveznice	1 000 000 EUR
Pokrivene obveznice	5 000 000 EUR

Tablica 2.4.

Obveznice (vrste ETC i ETN) – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – obveznice (vrsta ETC i ETN)	
Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6.a primjenjuje se sljedeća metodologija:	
Roba kojom se trguje na burzi (ETC-i) – RTS2#3 = ETCS: dužnički instrument koji se izdaje za izravno ulaganje izdavatelja u robu ili ugovore o robnim izvedenicama. Cijena ETC-a izravno je ili neizravno povezana s rezultatom odnosnog instrumenta. ETC pasivno replicira rezultat robe ili indeksa robe na koji se odnosi.	Za sve ETC-e smatra se da ne postoji likvidno tržište.
Dužnički instrumenti kojima se trguje na burzi (ETN-i) – RTS2#3 = ETNS: dužnički instrument koji se izdaje za izravno ulaganje izdavatelja u odnosni instrument ili odnosne ugovore o izvedenicama. Cijena ETN-a izravno je ili neizravno povezana s rezultatom odnosnog instrumenta. ETN pasivno replicira rezultat odnosnog instrumenta.	Za sve ETN-e smatra se da ne postoji likvidno tržište.

Tablica 2.5.

Obveznice (vrste ETC i ETN) – prag za LIS prije trgovanja

Razred imovine – obveznice (vrste ETC i ETN)	
Vrsta obveznice	**LIS prije trgovanja**
ETC-i	1 000 000 EUR
ETN-i	1 000 000 EUR

▼M4

Tablica 2.6.

Obveznice (sve vrste osim ETC-a i ETN-a) – režim odgode objave

Razred imovine – obveznice (sve vrste osim ETC-a i ETN-a)			
Vrsta obveznice	**Kategorija**	**Likvidnost**	**Veličina (minimalni iznos)**
Državne obveznice iz grupe G1 u skladu s tablicom 2.2	1	Smatra se da postoji likvidno tržište.	15 000 000 EUR
	2	Smatra se da ne postoji likvidno tržište.	5 000 000 EUR
	3	Smatra se da postoji likvidno tržište.	50 000 000 EUR
	4	Smatra se da ne postoji likvidno tržište.	15 000 000 EUR
	5	Smatra se da postoji likvidno tržište.	100 000 000 EUR
	5	Smatra se da ne postoji likvidno tržište.	50 000 000 EUR
Državne obveznice i druge javne obveznice iz grupe G2 u skladu s tablicom 2.2	1	Smatra se da postoji likvidno tržište.	10 000 000 EUR
	2	Smatra se da ne postoji likvidno tržište.	1 000 000 EUR
	3	Smatra se da postoji likvidno tržište.	20 000 000 EUR
	4	Smatra se da ne postoji likvidno tržište.	2 000 000 EUR
	5	Smatra se da postoji likvidno tržište.	50 000 000 EUR
	5	Smatra se da ne postoji likvidno tržište.	5 000 000 EUR
Korporativne, konvertibilne i druge obveznice iz grupe G3 u skladu s tablicom 2.2	1	Smatra se da postoji likvidno tržište.	1 500 000 EUR
	2	Smatra se da ne postoji likvidno tržište.	500 000 EUR
	3	Smatra se da postoji likvidno tržište.	7 500 000 EUR
	4	Smatra se da ne postoji likvidno tržište.	2 000 000 EUR
	5	Smatra se da postoji likvidno tržište.	15 000 000 EUR
	5	Smatra se da ne postoji likvidno tržište.	5 000 000 EUR

▼M4

Razred imovine – obveznice (sve vrste osim ETC-a i ETN-a)			
Vrsta obveznice	**Kategorija**	**Likvidnost**	**Veličina (minimalni iznos)**
Korporativne, konvertibilne i druge obveznice iz grupe G4 u skladu s tablicom 2.2	1	Smatra se da postoji likvidno tržište.	1 000 000 EUR
	2	Smatra se da ne postoji likvidno tržište.	500 000 EUR
	3	Smatra se da postoji likvidno tržište.	5 000 000 EUR
	4	Smatra se da ne postoji likvidno tržište.	2 000 000 EUR
	5	Smatra se da postoji likvidno tržište.	10 000 000 EUR
	5	Smatra se da ne postoji likvidno tržište.	5 000 000 EUR
Pokrivene obveznice iz grupe G5 u skladu s tablicom 2.2	1	Smatra se da postoji likvidno tržište.	5 000 000 EUR
	2	Smatra se da ne postoji likvidno tržište.	1 000 000 EUR
	3	Smatra se da postoji likvidno tržište.	20 000 000 EUR
	4	Smatra se da ne postoji likvidno tržište.	5 000 000 EUR
	5	Smatra se da postoji likvidno tržište.	50 000 000 EUR
	5	Smatra se da ne postoji likvidno tržište.	10 000 000 EUR

3. **Strukturirani financijski proizvodi (SFP-i)**

Tablica 3.1.

SFP-i – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – strukturirani financijski proizvodi (SFP-i)
Procjena razreda imovine strukturirani financijski proizvodi za potrebe utvrđivanja financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6.a – RTS2#3 = SFPS.
Za sve SFP-e smatra se da ne postoji likvidno tržište.

Tablica 3.2.

SFP-i – prag za LIS prije trgovanja

Razred imovine – strukturirani financijski proizvodi (SFP-i)
LIS prije trgovanja
250 000 EUR

▼B

4. **Sekuritizirane izvedenice**

▼M3

Tablica 4.1.

Sekuritizirane izvedenice – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – sekuritizirane izvedenice
To su prenosivi vrijednosni papiri kako su definirani u članku 4. stavku 1. točki 44. podtočki (c) Direktive 2014/65/EU koji se razlikuju od strukturiranih financijskih proizvoda i uključuju najmanje sljedeće:
(a.1) standardne (*plain vanilla*) pokrivene varante, a to su vrijednosni papiri koje izdaje financijska institucija i kojima vlasnik stječe pravo, ali ne i obvezu,
(a) da na datum isteka ili do tog datuma kupi određenu količinu odnosne imovine po unaprijed utvrđenoj izvršnoj cijeni ili, ako je utvrđena namira u novcu, pravo da od prodavatelja primi isplatu pozitivne razlike između trenutačne tržišne cijene i izvršne cijene ili
(b) da na datum isteka ili do tog datuma proda određenu količinu odnosne imovine po unaprijed utvrđenoj izvršnoj cijeni ili, ako je utvrđena namira u novcu, pravo da od kupca primi isplatu pozitivne razlike između izvršne cijene i trenutačne tržišne cijene;
(a.2) varante, a to su vrijednosni papiri koje izdaje izdavatelj odnosne imovine kojima vlasnik stječe pravo, ali ne i obvezu,
(a) da na datum isteka ili do tog datuma kupi određenu količinu odnosne imovine po unaprijed utvrđenoj izvršnoj cijeni ili, ako je utvrđena namira u novcu, pravo da od prodavatelja primi isplatu pozitivne razlike između trenutačne tržišne cijene i izvršne cijene ili
(b) da na datum isteka ili do tog datuma proda određenu količinu odnosne imovine po unaprijed utvrđenoj izvršnoj cijeni ili, ako je utvrđena namira u novcu, pravo da od kupca primi isplatu pozitivne razlike između izvršne cijene i trenutačne tržišne cijene;
(b) certifikate s financijskom polugom, a to su certifikati kojima se replicira rezultat odnosne imovine s učinkom poluge;
(c) egzotične pokrivene varante, a to su pokriveni varanti čija je osnovna komponenta kombinacija opcija;
(d) prenosiva prava čija je odnosna imovina nevlasnički instrument;
(e) certifikate s ulaganjima, a to su certifikati kojima se replicira rezultat odnosne imovine bez učinka poluge.
RTS2#3 = SDRV
Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija
Smatra se da za sve sekuritizirane izvedenice postoji likvidno tržište.

▼M4

Tablica 4.2.

Sekuritizirane izvedenice – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i veliki tržišni obujam (LIS) prije i poslije trgovanja

Razred imovine – sekuritizirane izvedenice		
Pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja		
LIS prije trgovanja	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

▼B

5. **Kamatne izvedenice**

▼M3

Tablica 5.1.

Kamatne izvedenice – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – kamatne izvedenice				
Svaki ugovor kako je definiran u odjeljku C točki 4. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU u kojem je krajnji odnosni instrument kamatna stopa, obveznica, kredit, bilo koja košarica, portfelj ili indeks koji uključuje kamatnu stopu, obveznicu, kredit ili svaki drugi proizvod koji predstavlja rezultat kamatne stope, obveznice ili kredita.				
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji**		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
Obvezničke budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na obveznice / Budućnosnica na obvezničku budućnosnicu	Podrazred obveznička budućnosnica / terminski ugovor koji se odnosi na obveznice definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS2#17) – izdavatelj odnosnog instrumenta **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#18) – trajanje odnosne obveznice s isporukom definira se kako slijedi:	5 000 000 EUR	10	Svaki put kad se utvrdi da za podrazred postoji likvidno tržište s obzirom na određeno vrijeme do razreda dospijeća, a za podrazred definiran sljedećim vremenom do razdoblja

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
/ Terminski ugovor o obvezničkoj budućnosniciObveznička budućnosnica **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = BOND** **ili** **terminski ugovor koji se odnosi na obveznicu** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FORW** **RTS2#16 = BOND** **ili** **Budućnosnica na obvezničku budućnosnicu** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR**	**kratkoročna**: odnosna obveznica s isporukom trajanja do 4 godine smatra se kratkoročnom **srednjoročna**: odnosna obveznica s isporukom trajanja od 4 do 8 godina smatra se srednjoročnom **dugoročna**: odnosna obveznica s isporukom trajanja od 8 do 15 godina smatra se dugoročnom **vrlo dugoročna**: odnosna obveznica s isporukom trajanja duljeg od 15 godina smatra se vrlo dugoročnom **Kriterij segmentacije 3** – vrijeme do razreda dospijeća budućnosnice definirano je kako slijedi: Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca Razred dospijeća 2: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci Razred dospijeća 3: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina Razred dospijeća 4: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine Razred dospijeća 5: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina			dospijeća utvrdi da ne postoji likvidno tržište, utvrđuje se da za prvi ugovor s najduljim dospijećem (*back month contract*) likvidno tržište postoji dva tjedna prije isteka ugovora s najkraćim dospijećem (*front month contract*)

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
RTS2#5 = FUTR **RTS2#16 = BNFD** **ili** **Terminski ugovor o obvezničkoj budućnosnici** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FORW** **RTS2#16 = BNFD**				
Obveznička opcija **/ Opcija na obvezničku opciju** **/ Opcija na obvezničku budućnosnicu** **Obveznička opcija** **Opcija na obvezničku opciju** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR**	Podrazred obveznička opcija definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS2#22) – krajnja odnosna obveznica **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća opcije definirano je kako slijedi: Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca Razred dospijeća 2: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci Razred dospijeća 3: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina Razred dospijeća 4: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine Razred dospijeća 5: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	5 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
RTS2#5 = OPTN **RTS2#16 = BOND** **ili** **Opcija na obvezničku opciju** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = BOND** **ili** **Opcija na obvezničku budućnosnicu** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = BNFD**				

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
Kamatne budućnosnice i kamatni terminski ugovori / budućnosnica na kamatnu budućnosnicu / kamatni terminski ugovor na kamatnu budućnosnicu **Kamatna budućnosnica** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = INTR** **ili** **Terminski ugovor o kamatnoj stopi** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FRAS** **RTS2#16 = INTR** **ili** **budućnosnica na kamatnu budućnosnicu**	Podrazred kamatna budućnosnica definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS2#24) – odnosna kamatna stopa **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#25) – rok odnosne kamatne stope **Kriterij segmentacije 3** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća budućnosnice definirano je kako slijedi: Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca Razred dospijeća 2: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci Razred dospijeća 3: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina Razred dospijeća 4: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine Razred dospijeća 5: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	500 000 000 EUR	10	Svaki put kad se utvrdi da za podrazred postoji likvidno tržište s obzirom na određeno vrijeme do razreda dospijeća, a za podrazred definiran sljedećim vremenom do razreda dospijeća utvrdi da ne postoji likvidno tržište, za prvi ugovor s najduljim dospijećem (*back month contract*) utvrđuje se da postoji likvidno tržište dva tjedna prije isteka ugovora s najkraćim dospijećem (*front month contract*)

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
RTS2#3 = DERV **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = IFUT** **ili** **kamatni terminski ugovor na kamatnu budućnosnicu** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FRAS** **RTS2#16 = IFUT**				
Kamatne opcije **/ Opcija na kamatnu budućnosnicu/FRA** **/ Opcija na kamatnu opciju**	podrazred kamatna opcija definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS2#24) – odnosna kamatna stopa **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#25) – rok odnosne kamatne stope **Kriterij segmentacije 3** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća opcije definirano je kako slijedi: Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca	500 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
/ Opcija na opciju na kamatnu budućnosnicu/FRA **Opcija na kamatnu budućnosnicu/FRA//opcija na kamatnu opciju** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = IFUT** **ili** **Kamatna opcija // opcija na opciju na kamatnu budućnosnicu/FRA** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = INTR**	Razred dospijeća 2: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci Razred dospijeća 3: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina Razred dospijeća 4: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine Razred dospijeća 5: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina			

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
Opcije razmjene **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = SWPT**	Podrazred opcija razmjene definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS2#16) – vrsta odnosnog ugovora o razmjeni definirana je kako slijedi: jednovalutni ugovor o razmjeni fiksne za fiksnu kamatnu stopu, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na jednovalutni ugovor o razmjeni fiksne za fiksnu kamatnu stopu [**RTS2#16 = XXSC**] jednovalutni ugovor o razmjeni fiksne za promjenjivu kamatnu stopu, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na jednovalutni ugovor o razmjeni fiksne za promjenjivu kamatnu stopu [**RTS2#16 = XFSC**] jednovalutni ugovor o razmjeni promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na jednovalutni ugovor o razmjeni promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu [**RTS2#16 = FFSC**] inflacijski jednovalutni ugovor o razmjeni, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na inflacijski jednovalutni ugovor o razmjeni [**RTS2#16 = IFSC**] prekonoćni kamatni jednovalutni ugovor o razmjeni, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na prekonoćni kamatni jednovalutni ugovor o razmjeni [**RTS2#16 = OSSC**] viševalutni ugovor o razmjeni fiksne za fiksnu kamatnu stopu, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na viševalutni ugovor o razmjeni fiksne za fiksnu kamatnu stopu [**RTS2#16 = XXMC**]	500 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
	višestrani ugovor o razmjeni fiksne za promjenjivu kamatnu stopu, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na višestrani ugovor o razmjeni fiksne za promjenjivu kamatnu stopu [**RTS2#16 = XFMC**] višestrani ugovor o razmjeni promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na višestrani ugovor o razmjeni promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu [**RTS2#16 = FFMC**] inflacijski višestrani ugovor o razmjeni, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na inflacijski višestrani ugovor o razmjeni [**RTS2#16 = IFMC**] prekonoćni višestrani ugovor o razmjeni, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na prekonoćni višestrani ugovor o razmjeni [**RTS2#16 = OSMC**] **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#20) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa opcije **Kriterij segmentacije 3** (RTS2#22 ili RTS2#23) – inflacijski indeks ako je odnosni ugovor o razmjeni inflacijski jednovalutni ili inflacijski višestrani ugovor o razmjeni **Kriterij segmentacije 4** (RTS2#21) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi: Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec Razred dospijeća 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca			

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
	Razred dospijeća 3: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci Razred dospijeća 4: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina Razred dospijeća 5: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine Razred dospijeća 6: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina **Kriterij segmentacije 5** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća opcije definirano je kako slijedi: **Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci **Razred dospijeća 2**: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina **Razred dospijeća 3**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine **Razred dospijeća 4**: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 5 godine **Razred dospijeća 5**: 5 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 10 godine **Razred dospijeća 6**: dulje od 10 godina			

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
„Viševalutni ili međuvalutni ugovori o razmjeni" fiksne za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori/opcije koji se odnose na „viševalutne ili međuvalutne ugovore o razmjeni" fiksne za promjenjivu kamatnu stopu ugovor o razmjeni ili budućnosnica/terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u istoj valuti i novčani tokovi jedne platne strane utvrđeni su s fiksnom kamatnom stopom, dok su novčani tokovi druge platne strane utvrđeni s promjenjivom kamatnom stopom. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS RTS2#16 = XFMC	podrazred viševalutni ugovor o razmjeni fiksne za promjenjivu kamatnu stopu definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#13 i RTS23#42) – valutni par zamišljenog iznosa definiran je kao kombinacija dviju valuta u kojima su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi: Razred dospijeća 1: 0 < dospijeće ≤ 1 mjesec Razred dospijeća 2: 1 mjesec < dospijeće ≤ 3 mjeseca Razred dospijeća 3: 3 mjeseca < dospijeće ≤ 6 mjeseci Razred dospijeća 4: 6 mjeseci < dospijeće ≤ 1 godina Razred dospijeća 5: 1 godina < dospijeće ≤ 2 godine Razred dospijeća 6: 2 godine < dospijeće ≤ 3 godine … Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
„Viševalutni ili međuvalutni ugovori o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori/opcije koji se odnose na „viševalutne ili međuvalutne ugovore o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu ugovor o razmjeni ili budućnosnica/terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u različitim valutama i u kojem su novčani tokovi obje platne strane utvrđeni s promjenjivim kamatnim stopama RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS RTS2#16 = FFMC	podrazred viševalutni ugovor o razmjeni promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#13 i RTS23#42) –valutni par zamišljenog iznosa definiran je kao kombinacija dviju valuta u kojima su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi: Razred dospijeća 1: 0 < dospijeće ≤ 1 mjesec Razred dospijeća 2: 1 mjesec < dospijeće ≤ 3 mjeseca Razred dospijeća 3: 3 mjeseca < dospijeće ≤ 6 mjeseci Razred dospijeća 4: 6 mjeseci < dospijeće ≤ 1 godina Razred dospijeća 5: 1 godina < dospijeće ≤ 2 godine Razred dospijeća 6: 2 godine < dospijeće ≤ 3 godine … Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
„Viševalutni ili međuvalutni ugovori o razmjeni" fiksne za fiksnu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori/opcije koji se odnose na „viševalutne ili međuvalutne ugovore o razmjeni" fiksne za fiksnu kamatnu stopu ugovor o razmjeni ili budućnosnica/terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u različitim valutama i u kojem su novčani tokovi obje platne strane utvrđeni s fiksnim kamatnim stopama RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS RTS2#16 = XXMC	podrazred viševalutni ugovor o razmjeni fiksne za fiksnu kamatnu stopu definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#13 i RTS23#42) –valutni par zamišljenog iznosa definiran je kao kombinacija dviju valuta u kojima su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi: Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec Razred dospijeća 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca Razred dospijeća 3: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci Razred dospijeća 4: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina Razred dospijeća 5: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine Razred dospijeća 6: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
Prekonoćni kamatni „viševalutni ili međuvalutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice/terminski ugovori/opcije koji se odnose na prekonoćne kamatne „viševalutne ili međuvalutne ugovore o razmjeni” ugovor o razmjeni ili budućnosnica/terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u različitim valutama i u kojem su novčani tokovi barem jedne strane utvrđeni s prekonoćnom indeksiranom kamatnom stopom RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS RTS2#16 = OSMC	podrazred prekonoćni kamatni viševalutni ugovor o razmjeni definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#13 i RTS23#42) –valutni par zamišljenog iznosa definiran je kao kombinacija dviju valuta u kojima su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi: Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec Razred dospijeća 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca Razred dospijeća 3: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci Razred dospijeća 4: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina Razred dospijeća 5: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine Razred dospijeća 6: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
Inflacijski „viševalutni ili međuvalutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice/terminski ugovori/opcije koji se odnose na inflacijske „viševalutne ili međuvalutne ugovore o razmjeni” ugovor o razmjeni ili budućnosnica/terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u različitim valutama i u kojem su novčani tokovi barem jedne platne strane utvrđeni sa stopom inflacije **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS RTS2#16 = IFMC	podrazred inflacijski viševalutni ugovor o razmjeni definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#13 i RTS23#42) –valutni par zamišljenog iznosa definiran je kao kombinacija dviju valuta u kojima su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi: Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec Razred dospijeća 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca Razred dospijeća 3: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci Razred dospijeća 4: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina Razred dospijeća 5: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine Razred dospijeća 6: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
„Jednovalutni ugovori o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori/opcije koji se odnose na „jednovalutne ugovore o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu ugovor o razmjeni ili budućnosnica/terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u istoj valuti i novčani tokovi jedne platne strane utvrđeni su s fiksnom kamatnom stopom, dok su novčani tokovi druge platne strane utvrđeni s promjenjivom kamatnom stopom **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS RTS2#16 = XFSC	podrazred jednovalutni ugovor o razmjeni fiksne za promjenjivu kamatnu stopu definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#13) – valuta zamišljenog iznosa u kojoj su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi: Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec Razred dospijeća 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca Razred dospijeća 3: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci Razred dospijeća 4: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina Razred dospijeća 5: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine Razred dospijeća 6: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
„Jednovalutni ugovori o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice/ terminski ugovori/opcije koji se odnose na „jednovalutne ugovore o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu ugovor o razmjeni ili budućnosnica/ terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u istoj valuti i u kojem su novčani tokovi obje platne strane utvrđeni s promjenjivim kamatnim stopama RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS RTS2#16 = FFSC	podrazred jednovalutni ugovor o razmjeni promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#13) – valuta zamišljenog iznosa u kojoj su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi: Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec Razred dospijeća 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca Razred dospijeća 3: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci Razred dospijeća 4: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina Razred dospijeća 5: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine Razred dospijeća 6: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
„Jednovalutni ugovori o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori/opcije koji se odnose na „jednovalutne ugovore o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu ugovor o razmjeni ili budućnosnica/terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u istoj valuti i u kojem su novčani tokovi obje platne strane utvrđeni s fiksnim kamatnim stopama RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS RTS2#16 = XXSC	podrazred jednovalutni ugovor o razmjeni fiksne za fiksnu kamatnu stopu definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#13) – valuta zamišljenog iznosa u kojoj su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi: Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec Razred dospijeća 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca Razred dospijeća 3: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci Razred dospijeća 4: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina Razred dospijeća 5: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine Razred dospijeća 6: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
Prekonoćni kamatni jednovalutni ugovori o razmjeni i budućnosnice/ terminski ugovori/opcije koji se odnose na prekonoćne kamatne jednovalutne ugovore o razmjeni ugovor o razmjeni ili budućnosnica/ terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u istoj valuti i u kojem su novčani tokovi barem jedne strane utvrđeni s prekonoćnom indeksiranom kamatnom stopom **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS RTS2#16 = OSSC	podrazred prekonoćni kamatni jednovalutni ugovor o razmjeni definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#13) – valuta zamišljenog iznosa u kojoj su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi: Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec Razred dospijeća 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca Razred dospijeća 3: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci Razred dospijeća 4: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina Razred dospijeća 5: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine Razred dospijeća 6: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti**
Inflacijski „jednovalutni ugovori o razmjeni" i budućnosnice/terminski ugovori/opcije koji se odnose na inflacijske „jednovalutne ugovore o razmjeni" ugovor o razmjeni ili budućnosnica/terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u istoj valuti i u kojem su novčani tokovi barem jedne platne strane utvrđeni sa stopom inflacije **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS RTS2#16 = IFSC	podrazred inflacijski jednovalutni ugovor o razmjeni definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#13) – valuta zamišljenog iznosa u kojoj su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi: Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec Razred dospijeća 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca Razred dospijeća 3: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci Razred dospijeća 4: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina Razred dospijeća 5: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine Razred dospijeća 6: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Razred imovine – kamatne izvedenice	
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrdivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija**
Druge kamatne izvedenice Kamatna izvedenica koja ne pripada ni u koji od prethodno navedenih podrazreda imovine **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = OTHR	Smatra se da za sve druge kamatne izvedenice ne postoji likvidno tržište.

▼M4

Tablica 5.2.

Kamatne izvedenice – pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da postoji likvidno tržište

Razred imovine – kamatne izvedenice									
Podrazred imovine	**Percentili i donji pragovi koji se primjenjuju za izračun pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji se smatra da postoji likvidno tržište**								
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova	**LIS prije trgovanja**		**SSTI poslije trgovanja**			**LIS poslije trgovanja**		
		Trgovanje – percentil	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**
Obvezničke budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na obveznice	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	5 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
Obvezničke opcije	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	5 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
Kamatne budućnosnice i terminski ugovori o kamatnoj stopi	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	10 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR

▼M4

Razred imovine – kamatne izvedenice									
Podrazred imovine	**Percentili i donji pragovi koji se primjenjuju za izračun pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji se smatra da postoji likvidno tržište**								
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova	**LIS prije trgovanja**		**SSTI poslije trgovanja**			**LIS poslije trgovanja**		
		Trgovanje – percentil	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**
Kamatne opcije	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	10 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
Opcije razmjene	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
„Viševalutni ugovori o razmjeni” ili „međuvalutni ugovori o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na „viševalutne ugovore o razmjeni” ili „međuvalutne ugovore o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Razred imovine – kamatne izvedenice									
Podrazred imovine	**Percentili i donji pragovi koji se primjenjuju za izračun pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji se smatra da postoji likvidno tržište**								
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova	**LIS prije trgovanja**		**SSTI poslije trgovanja**			**LIS poslije trgovanja**		
		Trgovanje – percentil	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**
„Viševalutni ugovori o razmjeni” ili „međuvalutni ugovori o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na „viševalutne ugovore o razmjeni” ili „međuvalutne ugovore o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
„Viševalutni ugovori o razmjeni” ili „međuvalutni ugovori o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na „viševalutne ugovore o razmjeni” ili „međuvalutne ugovore o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Razred imovine – kamatne izvedenice									
Podrazred imovine	**Percentili i donji pragovi koji se primjenjuju za izračun pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji se smatra da postoji likvidno tržište**								
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova	**LIS prije trgovanja**		**SSTI poslije trgovanja**			**LIS poslije trgovanja**		
		Trgovanje – percentil	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**
Prekonoćni kamatni „viševalutni ugovori o razmjeni” ili „međuvalutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na prekonoćne kamatne „viševalutne ugovore o razmjeni” ili „međuvalutne ugovore o razmjeni”	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Inflacijski „viševalutni ugovori o razmjeni” ili „međuvalutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na inflacijske „viševalutne ugovore o razmjeni” ili „međuvalutne ugovore o razmjeni”	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
„„Jednovalutni ugovori o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na „jednovalutne ugovore o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Razred imovine – kamatne izvedenice									
Podrazred imovine	**Percentili i donji pragovi koji se primjenjuju za izračun pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji se smatra da postoji likvidno tržište**								
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova	**LIS prije trgovanja**		**SSTI poslije trgovanja**			**LIS poslije trgovanja**		
		Trgovanje – percentil	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**
„Jednovalutni ugovori o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na „jednovalutne ugovore o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
„Jednovalutni ugovori o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na „jednovalutne ugovore o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Prekonoćni kamatni „jednovalutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na prekonoćne kamatne „jednovalutne ugovore o razmjeni”	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Razred imovine – kamatne izvedenice									
Podrazred imovine	**Percentili i donji pragovi koji se primjenjuju za izračun pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji se smatra da postoji likvidno tržište**								
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova	**LIS prije trgovanja**		**SSTI poslije trgovanja**			**LIS poslije trgovanja**		
		Trgovanje – percentil	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**
Inflacijski „jednovalutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na inflacijske „jednovalutne ugovore o razmjeni”	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

Tablica 5.3.

Kamatne izvedenice – pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – kamatne izvedenice			
Podrazred imovine	**Pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji se smatra da ne postoji likvidno tržište**		
	LIS prije trgovanja	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
	Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
Obvezničke budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na obveznice	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Obvezničke opcije	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Kamatne budućnosnice i terminski ugovori o kamatnoj stopi	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR

▼M4

Razred imovine – kamatne izvedenice			
Podrazred imovine	**Pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji se smatra da ne postoji likvidno tržište**		
	LIS prije trgovanja	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
	Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
Kamatne opcije	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Opcije razmjene	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Viševalutni ugovori o razmjeni” ili „međuvalutni ugovori o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na „viševalutne ugovore o razmjeni” ili „međuvalutne ugovore o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Viševalutni ugovori o razmjeni” ili „međuvalutni ugovori o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na „viševalutne ugovore o razmjeni” ili „međuvalutne ugovore o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Viševalutni ugovori o razmjeni” ili „međuvalutni ugovori o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na „viševalutne ugovore o razmjeni” ili „međuvalutne ugovore o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Prekonoćni kamatni „viševalutni ugovori o razmjeni” ili „međuvalutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na prekonoćne kamatne „viševalutne ugovore o razmjeni” ili „međuvalutne ugovore o razmjeni”	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Inflacijski „viševalutni ugovori o razmjeni” ili „međuvalutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na inflacijske „viševalutne ugovore o razmjeni” ili „međuvalutne ugovore o razmjeni”	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Jednovalutni ugovori o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na „jednovalutne ugovore o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR

▼M4

Razred imovine – kamatne izvedenice			
Podrazred imovine	**Pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji se smatra da ne postoji likvidno tržište**		
	LIS prije trgovanja	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
	Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
„Jednovalutni ugovori o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na „jednovalutne ugovore o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Jednovalutni ugovori o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na „jednovalutne ugovore o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Prekonoćni kamatni „jednovalutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na prekonoćne kamatne „jednovalutne ugovore o razmjeni”	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Inflacijski „jednovalutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na inflacijske „jednovalutne ugovore o razmjeni”	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Druge kamatne izvedenice	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR

▼B

6. **Vlasničke izvedenice**

▼M3

Tablica 6.1.

Vlasničke izvedenice – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – vlasničke izvedenice
Svi ugovori kako su definirani u odjeljku C točki 4. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU koji se odnose na:
(a) jednu ili više dionica, potvrde o deponiranim vrijednosnim papirima, certifikate, fondove čijim se udjelima trguje na burzi, certifikate, druge slične financijske instrumente, novčane tokove ili druge proizvode povezane s rezultatom jedne ili više dionica, potvrda o deponiranim vrijednosnim papirima, fondova čijim se udjelima trguje na burzi, certifikata ili drugih sličnih financijskih instrumenata;
(b) indeks dionica, potvrde o deponiranim vrijednosnim papirima, certifikate, fondove čijim se udjelima trguje na burzi, certifikate, druge slične financijske instrumente, novčane tokove ili ostale proizvode povezane s rezultatom jedne ili više dionica, potvrda o deponiranim vrijednosnim papirima, certifikata, fondova čijim se udjelima trguje na burzi ili drugih sličnih financijskih instrumenata

▼M3

Razred imovine – vlasničke izvedenice	
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija**
Opcije na dionički indeks opcija čiji je odnosni instrument indeks sastavljen od dionica RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = STIX RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28	Smatra se da za sve opcije na indekse postoji likvidno tržište.
Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na dioničke indekse Budućnosnica/terminski ugovor čiji je odnosni instrument indeks sastavljen od dionica RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR ili FORW RTS2#27 = STIX RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28	Smatra se da za sve budućnosnice/terminske ugovore koji se odnose na indekse postoji likvidno tržište.
Dioničke opcije Opcija čiji je odnosni instrument dionica ili košarica dionica koja proizlazi iz korporativne akcije. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = SHRS RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28	Smatra se da za sve opcije na dionice postoji likvidno tržište.

▼M3

Razred imovine – vlasničke izvedenice	
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija**
Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na dionice Budućnosnica/terminski ugovor čiji je odnosni instrument dionica ili košarica dionica koja proizlazi iz korporativne akcije. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR ili FORW RTS2#27 = SHRS RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28	smatra se da za sve budućnosnice/terminske ugovore koji se odnose na dionice postoji likvidno tržište
Opcije na dividendu dionice opcija na dividendu određene dionice RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = DVSE RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28	Smatra se da za sve opcije na dividendu dionice postoji likvidno tržište.
Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na dividendu dionice budućnosnica/terminski ugovor koji se odnosi na dividendu određene dionice RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR ili FORW RTS2#27 = DVSE RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28	Smatra se da za sve budućnosnice/terminske ugovore koji se odnose na dividendu dionice postoji likvidno tržište.

▼M3

Razred imovine – vlasničke izvedenice	
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija**
Opcije na indeks dividendi Opcija na indeks sastavljen od dividendi na više od jedne dionice. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = DIVI RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28	Smatra se da za sve opcije na indeks dividendi postoji likvidno tržište.
Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na indeks dividendi Budućnosnica/terminski ugovor koji se odnosi na indeks sastavljen od dividendi na više od jedne dionice. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR ili FORW RTS2#27 = DIVI RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28	Smatra se da za sve budućnosnice/terminske ugovore koji se odnose na indeks dividendi postoji likvidno tržište.
Opcije na indeks volatilnosti Opcija čiji je odnosni instrument indeks volatilnosti koji se definira kao indeks koji se odnosi na volatilnost određenog odnosnog indeksa vlasničkih instrumenata. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = VOLI RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28	Smatra se da za sve opcije na indeks volatilnosti postoji likvidno tržište.

▼M3

Razred imovine – vlasničke izvedenice	
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija**
Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na indeks volatilnosti Budućnosnica/terminski ugovor čiji je odnosni instrument indeks volatilnosti koji se definira kao indeks koji se odnosi na volatilnost određenog odnosnog indeksa vlasničkih instrumenata RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR ili FORW RTS2#27 = VOLI RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28	Opcije na fondove čijim se udjelima trguje na burzi opcija čiji je odnosni instrument fond čijim se udjelima trguje na burzi
Opcije na fondove čijim se udjelima trguje na burzi opcija čiji je odnosni instrument fond čijim se udjelima trguje na burzi RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = ETFS RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28	Smatra se da za sve opcije na fondove čijim se udjelima trguje na burzi postoji likvidno tržište.
Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na fondove čijim se udjelima trguje na burzi Budućnosnica/terminski ugovor čiji je odnosni instrument fond čijim se udjelima trguje na burzi. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR ili FORW RTS2#27 = ETFS RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28	Smatra se da za sve budućnosnice/terminske ugovore koji se odnose na fondove čijim se udjelima trguje na burzi postoji likvidno tržište.

▼M3

<table>
<tr><th colspan="4">Razred imovine – vlasničke izvedenice</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Podrazred imovine</th><th colspan="3" rowspan="2">Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku</th><th colspan="2">Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti</th></tr>
<tr><th>Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]</th><th>Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]</th></tr>
<tr><td>Ugovori o razmjeni
RTS2#3 = DERV
RTS2#4 = EQUI
RTS2#5 = SWAP</td><td colspan="3">Podrazred ugovori o razmjeni definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:
Kriterij segmentacije 1 (RTS2#27) – vrsta odnosnog instrumenta: jedan subjekt, indeks, košarica
Kriterij segmentacije 2 (RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28) – vrsta odnosnog instrumenta: jedan subjekt, indeks, košarica
Kriterij segmentacije 3 (RTS2#28) – parametar: rezultat na osnovi cijene, rezultat na osnovi dividende, rezultat na osnovi varijance, rezultat na osnovi volatilnosti
Kriterij segmentacije 4 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:
<table>
<tr><td>Parametar rezultat na osnovi cijene</td><td>Parametar rezultat na osnovi varijance/volatilnosti</td><td>Parametar rezultat na osnovi dividende</td></tr>
<tr><td>Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec</td><td>Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca</td><td>Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina</td></tr>
<tr><td>Razred dospijeća 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca</td><td>Razred dospijeća 2: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci</td><td>Razred dospijeća 2: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine</td></tr>
<tr><td>Razred dospijeća 3: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci</td><td>Razred dospijeća 3: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina</td><td>Razred dospijeća 3: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine</td></tr>
<tr><td>Razred dospijeća 4: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina</td><td>Razred dospijeća 4: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine</td><td>…</td></tr>
</table></td><td>50 000 000 EUR</td><td></td></tr>
</table>

▼M3

Razred imovine – vlasničke izvedenice					
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**			**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti**	
				Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
	Razred dospijeća 5: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine	**Razred dospijeća 5**: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine	**Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina		
	Razred dospijeća 6: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine	…			
	…	**Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina			
	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina				
Ugovori o razmjeni na razini portfelja RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = PSWP	Podrazred ugovori o razmjeni na razini portfelja definiran je sljedećom posebnom kombinacijom: **Kriterij segmentacije 1** (RTS2#27) – vrsta odnosnog instrumenta: jedan subjekt, indeks, košarica **Kriterij segmentacije 2** (RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28) – vrsta odnosnog instrumenta: jedan subjekt, indeks, košarica **Kriterij segmentacije 3** (RTS2#28) – parametar: rezultat na osnovi cijene, rezultat na osnovi dividende, rezultat na osnovi varijance, rezultat na osnovi volatilnosti **Kriterij segmentacije 4** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi: **Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec **Razred dospijeća 2**: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca **Razred dospijeća 3**: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci **Razred dospijeća 4**: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina **Razred dospijeća 5**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine **Razred dospijeća 6**: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … **Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina			50 000 000 EUR	15

▼M3

Razred imovine – vlasničke izvedenice	
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija**
Druge kreditne izvedenice Kreditna izvedenica koja ne pripada ni u jedan od prethodno navedenih podrazreda imovine RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OTHR	Smatra se da za sve druge vlasničke izvedenice ne postoji likvidno tržište.

▼M4

Tablica 6.2.

Vlasničke izvedenice – pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da postoji likvidno tržište

Razred imovine – vlasničke izvedenice						
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja svaki podrazred imovine dodatno se segmentira na podrazrede kako je definirano u nastavku.**	**Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova**	**Granične vrijednosti za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja određene za podrazrede imovine za koje se smatra da postoji likvidno tržište na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) kojoj podrazred pripada**			
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	**LIS prije trgovanja**	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
				Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
Opcije na dionički indeks	Podrazred opcije na dionički indeks definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **kriterij segmentacije br. 1** – odnosni dionički indeks	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	ADNA < 100 mil. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mil. EUR ≤ ADNA < 600 mil. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≤ 600 mil. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Razred imovine – vlasničke izvedenice						
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja svaki podrazred imovine dodatno se segmentira na podrazrede kako je definirano u nastavku.**	**Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova**	**Granične vrijednosti za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja određene za podrazrede imovine za koje se smatra da postoji likvidno tržište na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) kojoj podrazred pripada**			
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	**LIS prije trgovanja**	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
				Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
Budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na dioničke indekse	Podrazred budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na dioničke indekse definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **kriterij segmentacije br. 1** – odnosni dionički indeks	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	ADNA < 100 mil. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 1 mlrd. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mlrd. EUR ≤ ADNA < 3 mlrd. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mlrd. EUR ≤ ADNA < 5 mlrd. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 mlrd. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Opcije na dionice	Podrazred opcije na dionice definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **kriterij segmentacije br. 1** – odnosna dionica	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	ADNA < 5 mil. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Razred imovine – vlasničke izvedenice						
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja svaki podrazred imovine dodatno se segmentira na podrazrede kako je definirano u nastavku.**	**Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova**	**Granične vrijednosti za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja određene za podrazrede imovine za koje se smatra da postoji likvidno tržište na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) kojoj podrazred pripada**			
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	**LIS prije trgovanja**	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
				Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
Budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na dionice	Podrazred budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na dionice definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **kriterij segmentacije br. 1** – odnosna dionica	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	ADNA < 5 mil. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
Opcije na dividendu dionice	Podrazred opcije na dividendu dionice definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **kriterij segmentacije br. 1** – odnosna dionica na temelju koje se ostvaruje pravo na dividendu	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	ADNA < 5 mil. EUR	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR

▼M4

Razred imovine – vlasničke izvedenice						
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja svaki podrazred imovine dodatno se segmentira na podrazrede kako je definirano u nastavku.**	**Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova**	**Granične vrijednosti za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja određene za podrazrede imovine za koje se smatra da postoji likvidno tržište na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) kojoj podrazred pripada**			
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	**LIS prije trgovanja**	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
				Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
Budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na dividendu dionice	Podrazred budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na dividendu dionice definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **kriterij segmentacije br. 1** – odnosna dionica na temelju koje se ostvaruje pravo na dividendu	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	ADNA < 5 mil. EUR	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR
Opcije na indeks dividendi	Podrazred opcije na indeks dividendi definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **kriterij segmentacije br. 1** – odnosni indeks dividendi	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	ADNA < 100 mil. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mil. EUR ≤ ADNA < 600 mil. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 mil. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Razred imovine – vlasničke izvedenice						
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja svaki podrazred imovine dodatno se segmentira na podrazrede kako je definirano u nastavku.**	**Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova**	**Granične vrijednosti za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja određene za podrazrede imovine za koje se smatra da postoji likvidno tržište na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) kojoj podrazred pripada**			
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	**LIS prije trgovanja**	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
				Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
Budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na indeks dividendi	Podrazred budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na indeks dividendi definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **kriterij segmentacije br. 1** – odnosni indeks dividendi	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	ADNA < 100 mil. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 1 mlrd. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mlrd. EUR ≤ ADNA < 3 mlrd. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mlrd. EUR ≤ ADNA < 5 mlrd. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 mlrd. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Opcije na indeks volatilnosti	Podrazred opcije na indeks volatilnosti definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **kriterij segmentacije br. 1** – odnosni indeks volatilnosti	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	ADNA < 100 mil. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mil. EUR ≤ ADNA < 600 mil. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 mil. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Razred imovine – vlasničke izvedenice						
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja svaki podrazred imovine dodatno se segmentira na podrazrede kako je definirano u nastavku.**	**Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova**	**Granične vrijednosti za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja određene za podrazrede imovine za koje se smatra da postoji likvidno tržište na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) kojoj podrazred pripada**			
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	**LIS prije trgovanja**	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
				Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
Budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na indeks volatilnosti	Podrazred budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na indeks volatilnosti definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **kriterij segmentacije br. 1** – odnosni indeks volatilnosti	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	ADNA < 100 mil. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 1 mlrd. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mlrd. EUR ≤ ADNA < 3 mlrd. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mlrd. EUR ≤ ADNA < 5 mlrd. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 mlrd. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Opcije na fondove čijim se udjelima trguje na burzi	Podrazred opcije na fondove čijim se udjelima trguje na burzi definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **kriterij segmentacije br. 1** – odnosni fond čijim se udjelima trguje na burzi	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	ADNA < 5 mil. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Razred imovine – vlasničke izvedenice						
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja svaki podrazred imovine dodatno se segmentira na podrazrede kako je definirano u nastavku.**	**Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova**	**Granične vrijednosti za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja određene za podrazrede imovine za koje se smatra da postoji likvidno tržište na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) kojoj podrazred pripada**			
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	**LIS prije trgovanja**	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
				Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
Budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na fondove čijim se udjelima trguje na burzi	Podrazred budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na fondove čijim se udjelima trguje na burzi definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **kriterij segmentacije br. 1** – odnosni fond čijim se udjelima trguje na burzi	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	ADNA < 5 mil. EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
Ugovori o razmjeni	Podrazred ugovori o razmjeni definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **kriterij segmentacije br. 1** – vrsta odnosnog instrumenta: jedan subjekt, indeks ili košarica **kriterij segmentacije br. 2** – odnosni instrument je jedan subjekt, indeks ili košarica **kriterij segmentacije br. 3** – parametar: rezultat na osnovi cijene, rezultat na osnovi dividende, rezultat na osnovi varijance, rezultat na osnovi volatilnosti **kriterij segmentacije br. 4** – razredi vremena do dospijeća ugovora o razmjeni definirani su kako slijedi:	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	50 mil. EUR ≤ ADNA < 100 mil. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 200 mil. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Razred imovine – vlasničke izvedenice								
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja svaki podrazred imovine dodatno se segmentira na podrazrede kako je definirano u nastavku.**			**Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova**	**Granične vrijednosti za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja određene za podrazrede imovine za koje se smatra da postoji likvidno tržište na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) kojoj podrazred pripada**			
					Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	**LIS prije trgovanja**	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
						Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
	Parametar rezultata na osnovi cijene	Parametar rezultata na osnovi varijance/volatilnosti	Parametar rezultata na osnovi dividende					
	1. razred dospijeća: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec	**1. razred dospijeća:** 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca	**1. razred dospijeća:** 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina					
	2. razred dospijeća: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca	**2. razred dospijeća:** 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci	**2. razred dospijeća:** 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine					
	3. razred dospijeća: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci	**3. razred dospijeća:** 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina	**3. razred dospijeća:** 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine					
	4. razred dospijeća: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina	**4. razred dospijeća:** 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine	…					

▼M4

Razred imovine – vlasničke izvedenice								
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja svaki podrazred imovine dodatno se segmentira na podrazrede kako je definirano u nastavku.**			**Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova**	**Granične vrijednosti za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja određene za podrazrede imovine za koje se smatra da postoji likvidno tržište na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) kojoj podrazred pripada**			
					Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	**LIS prije trgovanja**	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
						Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
	5. razred dospijeća: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine	**5. razred dospijeća:** 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine	**Razred dospijeća *m*:** (*n*-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina					
	6. razred dospijeća: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine	…						
	…	**Razred dospijeća *m*:** (*n*-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina						
	Razred dospijeća *m*: (*n*-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ *n* godina							
Ugovori o razmjeni na razini portfelja	Podrazred ugovora o razmjeni na razini portfelja definiran je sljedećom posebnom kombinacijom: **kriterij segmentacije br. 1** – vrsta odnosnog instrumenta: jedan subjekt, indeks ili košarica **kriterij segmentacije br. 2** – odnosni instrument je jedan subjekt, indeks ili košarica **kriterij segmentacije br. 3** – parametar: rezultat na osnovi cijene, rezultat na osnovi dividende, rezultat na osnovi varijance, rezultat na osnovi volatilnosti **kriterij segmentacije br. 4** – razredi vremena do dospijeća ugovora o razmjeni na razini portfelja definirani su kako slijedi:			Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	50 mil. EUR ≤ ADNA < 100 mil. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
					100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
					ADNA ≥ 200 mil. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Razred imovine – vlasničke izvedenice						
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja svaki podrazred imovine dodatno se segmentira na podrazrede kako je definirano u nastavku.**	**Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova**	**Granične vrijednosti za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja određene za podrazrede imovine za koje se smatra da postoji likvidno tržište na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) kojoj podrazred pripada**			
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	**LIS prije trgovanja**	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
				Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
	1. razred dospijeća: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec **2. razred dospijeća:** 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca **3. razred dospijeća:** 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci **4. razred dospijeća:** 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina **5. razred dospijeća:** 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine **6. razred dospijeća:** 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … **Razred dospijeća *m*:** (*n*-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ *n* godina					

Tablica 6.3.

Vlasničke izvedenice – pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – vlasničke izvedenice			
Podrazred imovine	**Pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište**		
	LIS prije trgovanja	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
	Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
Ugovori o razmjeni	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR
Ugovori o razmjeni na razini portfelja	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR
Druge vlasničke izvedenice	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR

▼B

7. **Robne izvedenice**

▼M3

Tablica 7.1.

Robne izvedenice – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

<table>
<tr><th colspan="4">Razred imovine – robne izvedenice</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Podrazred imovine</th><th rowspan="2" colspan="2">Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku</th><th colspan="2">Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti</th></tr>
<tr><th>Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]</th><th>Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]</th></tr>
<tr><td>Robne budućnosnice/ terminski ugovori koji se odnose na metale
RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS23#35 = METL i [RTS2#5 = FUTR ili FORW]</td><td colspan="2">Podrazred robna budućnosnica/terminski ugovor koji se odnosi na metale definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:
Kriterij segmentacije 1 (RTS23#36) – vrsta metala: plemeniti metali, neplemeniti metali
Kriterij segmentacije 2 (RTS23#37) – odnosni metal
Kriterij segmentacije 3 (RTS2#15) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa budućnosnice/terminskog ugovora
Kriterij segmentacije 4 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća budućnosnice definirano je kako slijedi:</td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
<tr><td></td><td>Plemeniti metali</td><td>Neplemeniti metali</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Razred dospijeća 1:
0 < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca</td><td>Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Razred dospijeća 2:
3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina</td><td>Razred dospijeća 2: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Razred dospijeća 3:
1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine</td><td>Razred dospijeća 3: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine</td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

<table>
<tr><td colspan="4">Razred imovine – robne izvedenice</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Podrazred imovine</td><td colspan="2" rowspan="2">Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku</td><td colspan="2">Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti</td></tr>
<tr><td>Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)
[kvantitativni kriterij likvidnosti 1]</td><td>Prosječni dnevni broj transakcija
[kvantitativni kriterij likvidnosti 2]</td></tr>
<tr><td></td><td>Razred dospijeća 4:
2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine</td><td>…</td><td rowspan="3"></td><td rowspan="3"></td></tr>
<tr><td></td><td>…</td><td>Razred dospijeća m:
(n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina</td></tr>
<tr><td></td><td>Razred dospijeća m:
(n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina</td><td></td></tr>
<tr><td>Robne opcije koje se odnose na metale
RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS23#35 = METL i RTS2#5 = OPTN</td><td colspan="2">Podrazred robne opcije koje se odnose na metale definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:
Kriterij segmentacije 1 (RTS23#36) – vrsta metala: plemeniti metali, neplemeniti metali
Kriterij segmentacije 2 (RTS23#37) – odnosni metal
Kriterij segmentacije 3 (RTS2#15) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa opcije
Kriterij segmentacije 4 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća opcije definirano je kako slijedi:</td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
<tr><td></td><td>Plemeniti metali</td><td>Neplemeniti metali</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Razred dospijeća 1:
0 < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca</td><td>Razred dospijeća 1:
0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Razred dospijeća 2:
3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina</td><td>Razred dospijeća 2:
1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine</td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

Razred imovine – robne izvedenice				
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**		**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti**	
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
	Razred dospijeća 3: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine	**Razred dospijeća 3**: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine		
	Razred dospijeća 4: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine	…		
	…	**Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina		
	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina			
Robni ugovori o razmjeni koji se odnose na metale RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS23#35 = METL i RTS2#5 = SWAP	Podrazred robni ugovori o razmjeni koji se odnose na metale definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#36) – vrsta metala: plemeniti metali, neplemeniti metali **Kriterij segmentacije 2** (RTS23#37) – odnosni metal **Kriterij segmentacije 3** (RTS2#15) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa ugovora o razmjeni **Kriterij segmentacije 4** (RTS23#34) – vrsta isporuke definirana je kao u gotovini, fizički ili drugo **Kriterij segmentacije 5** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:		10 000 000 EUR	10
	Plemeniti metali	**Neplemeniti metali**		
	Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca	**Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina		

▼M3

Razred imovine – robne izvedenice				
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**		**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti**	
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
	Razred dospijeća 2: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina	**Razred dospijeća 2**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine		
	Razred dospijeća 3: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine	**Razred dospijeća 3**: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine		
	Razred dospijeća 4: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine	…		
	…	**Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina		
	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina			
Robne budućnosnice/ terminski ugovori koji se odnose na energente RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS23#35 = NRGY i [RTS2#5 = FUTR ili FORW]	Podrazred robna budućnosnica/terminski ugovor koji se odnosi na energente definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#36) – vrsta energenta: nafta, naftni derivati, ugljen, lake frakcije nafte, prirodni plin, električna energija, kombinacija energetskih izvora **Kriterij segmentacije 2** (RTS23#37) – odnosni energent **Kriterij segmentacije 3** (RTS2#15) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa budućnosnice/terminskog ugovora **Kriterij segmentacije 4** – [brisano]		10 000 000 EUR	10

▼M3

<table>
<tr><td colspan="5">Razred imovine – robne izvedenice</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Podrazred imovine</td><td colspan="3" rowspan="2">Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku</td><td colspan="2">Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti</td></tr>
<tr><td>Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]</td><td>Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="3">Kriterij segmentacije 5 (RTS2#14) – mjesto isporuke / namire u novcu primjenjivo na vrste energenata
Kriterij segmentacije 6 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća budućnosnice/terminskog ugovora definirano je kako slijedi:</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Nafta/naftni derivati/lake frakcije nafte</td><td>Ugljen</td><td>Prirodni plin/električna energija/ kombinacija energetskih izvora</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Razred dospijeća 1:
0 < vrijeme do dospijeća ≤ 4 mjeseca</td><td>Razred dospijeća 1:
0 < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci</td><td>Razred dospijeća 1:
0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Razred dospijeća 2:
4 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 8 mjeseci</td><td>Razred dospijeća 2:
6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina</td><td>Razred dospijeća 2:
1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Razred dospijeća 3:
8 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina</td><td>Razred dospijeća 3:
1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine</td><td>Razred dospijeća 3:
1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Razred dospijeća 4:
1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine</td><td>…</td><td>…</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>…</td><td>Razred dospijeća m:
(n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina</td><td>Razred dospijeća m:
(n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Razred dospijeća m:
(n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina</td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

<table>
<tr><th colspan="4">Razred imovine – robne izvedenice</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Podrazred imovine</th><th rowspan="2">Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku</th><th colspan="2">Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti</th></tr>
<tr><th>Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]</th><th>Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]</th></tr>
<tr><td>Robne opcije koje se odnose na energente
RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS23#35 = NRGY i RTS2#5 = OPTN</td><td>Podrazred robne opcije koje se odnose na energente definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:
Kriterij segmentacije 1 (RTS23#36) – vrsta energenta: nafta, naftni derivati, ugljen, lake frakcije nafte, prirodni plin, električna energija, kombinacija energetskih izvora
Kriterij segmentacije 2 (RTS23#37) – odnosni energent
Kriterij segmentacije 3 (RTS2#15) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa opcije
Kriterij segmentacije 4 – [brisano]
Kriterij segmentacije 5 (RTS2#14) – mjesto isporuke / namire u novcu primjenjivo na vrste energenata
Kriterij segmentacije 6 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća opcije definirano je kako slijedi:
<table>
<tr><th>Nafta/naftni derivati/lake frakcije nafte</th><th>Ugljen</th><th>Prirodni plin/električna energija/ kombinacija energetskih izvora</th></tr>
<tr><td>Razred dospijeća 1:
0 < vrijeme do dospijeća ≤ 4 mjeseca</td><td>Razred dospijeća 1:
0 < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci</td><td>Razred dospijeća 1:
0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec</td></tr>
<tr><td>Razred dospijeća 2:
4 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 8 mjeseci</td><td>Razred dospijeća 2:
6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina</td><td>Razred dospijeća 2:
1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina</td></tr>
</table>
</td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
</table>

▼M3

Razred imovine – robne izvedenice					
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**			**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti**	
				Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
	Razred dospijeća 3: 8 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina	**Razred dospijeća 3**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine	**Razred dospijeća 3**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine		
	Razred dospijeća 4: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine	…	…		
	…	**Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	**Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina		
	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina				
Robni ugovori o razmjeni koji se odnose na energente RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS23#35 = NRGY i RTS2#5 = SWAP	Podrazred robni ugovori o razmjeni koji se odnose na energente definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#36) – vrsta energenta: nafta, naftni derivati, ugljen, lake frakcije nafte, prirodni plin, električna energija, kombinacija energetskih izvora **Kriterij segmentacije 2** (RTS23#37) – odnosni energent **Kriterij segmentacije 3** (RTS2#15) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa ugovora o razmjeni **Kriterij segmentacije 4** (RTS23#34) – vrsta isporuke definirana je kao u gotovini, fizički ili drugo **Kriterij segmentacije 5** – [brisano] **Kriterij segmentacije 6** (RTS2#14) – mjesto isporuke / namire u novcu primjenjivo na vrste energenata **Kriterij segmentacije 7** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:			10 000 000 EUR	10

▼M3

Razred imovine – robne izvedenice					
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**			**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti**	
				Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
	Nafta/naftni derivati/lake frakcije nafte	**Ugljen**	**Prirodni plin/električna energija/ kombinacija energetskih izvora**		
	Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 4 mjeseca	**Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci	**Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec		
	Razred dospijeća 2: 4 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 8 mjeseci	**Razred dospijeća 2**: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina	**Razred dospijeća 2**: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina		
	Razred dospijeća 3: 8 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina	**Razred dospijeća 3**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine	**Razred dospijeća 3**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine		
	Razred dospijeća 4: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine	…	…		
	…	**Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	**Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina		
	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina				
Robne budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na poljoprivredne proizvode RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS23#35 = AGRI i [RTS2#5 = FUTR ili FORW]	Podrazred robna budućnosnica/terminski ugovor koji se odnosi na poljoprivredne proizvode definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#36 i RTS23#37) – odnosni poljoprivredni proizvod (potproizvod i daljnji potproizvod) **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#15) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa budućnosnice/terminskog ugovora			10 000 000 EUR	10

▼M3

Razred imovine – robne izvedenice			
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti**	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
	Kriterij segmentacije 3 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća budućnosnice/terminskog ugovora definirano je kako slijedi: **Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca **Razred dospijeća 2**: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci **Razred dospijeća 3**: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina **Razred dospijeća 4**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine … **Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina		
Robne opcije koje se odnose na poljoprivredne proizvode RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS23#35 = AGRI i RTS2#5 = OPTN	Podrazred robne opcije koja se odnosi na poljoprivredni proizvod definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#36 i RTS23#37) – odnosni poljoprivredni proizvod (potproizvod i daljnji potproizvod) **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#15) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa opcije **Kriterij segmentacije 3** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća opcije definirano je kako slijedi: **Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca **Razred dospijeća 2**: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci **Razred dospijeća 3**: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina **Razred dospijeća 4**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine … **Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	10 000 000 EUR	10

▼M3

Razred imovine – robne izvedenice			
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti**	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Robni ugovori o razmjeni koji se odnose na poljoprivredne proizvode RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS23#35 = AGRI i RTS2#5 = SWAP	podrazred robni ugovori o razmjeni koji se odnose na poljoprivredne proizvode definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#36 i RTS23#37) – odnosni poljoprivredni proizvod (potproizvod i daljnji potproizvod) **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#15) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa ugovora o razmjeni **Kriterij segmentacije 3** (RTS23#34) – vrsta isporuke definirana je kao u gotovini, fizički ili drugo **Kriterij segmentacije 4** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi: **Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca **Razred dospijeća 2**: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci **Razred dospijeća 3**: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina **Razred dospijeća 4**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine … **Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	10 000 000 EUR	10
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija**		
Druge robne izvedenice robna izvedenica koja ne pripada ni u jedan od prethodno navedenih podrazreda imovine	Smatra se da za sve druge robne izvedenice ne postoji likvidno tržište.		

▼M4

Tablica 7.2.

Robne izvedenice – pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da postoji likvidno tržište

Razred imovine – robne izvedenice									
Podrazred imovine	**Percentili i donji pragovi koji se primjenjuju za izračun pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da postoji likvidno tržište**								
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova	**LIS prije trgovanja**		**SSTI poslije trgovanja**			**LIS poslije trgovanja**		
		Trgovanje – percentil	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**
Robne budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na metale	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Robne opcije koje se odnose na metale	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Robni ugovori o razmjeni koji se odnose na metale	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

▼M4

Razred imovine – robne izvedenice									
Podrazred imovine	**Percentili i donji pragovi koji se primjenjuju za izračun pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da postoji likvidno tržište**								
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova	**LIS prije trgovanja**		**SSTI poslije trgovanja**			**LIS poslije trgovanja**		
		Trgovanje – percentil	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**
Robne budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na energente	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Robne opcije koje se odnose na energente	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Robni ugovori o razmjeni koji se odnose na energente	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

▼M4

Razred imovine – robne izvedenice									
Podrazred imovine	**Percentili i donji pragovi koji se primjenjuju za izračun pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da postoji likvidno tržište**								
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova	**LIS prije trgovanja**		**SSTI poslije trgovanja**			**LIS poslije trgovanja**		
		Trgovanje – percentil	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**
Robne budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na poljoprivredne proizvode	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Robne opcije koje se odnose na poljoprivredne proizvode	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Robni ugovori o razmjeni koji se odnose na poljoprivredne proizvode	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

▼M4

Tablica 7.3.

Robne izvedenice – pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – robne izvedenice			
Podrazred imovine	**Pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište**		
	LIS prije trgovanja	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
	Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
Robne budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na metale	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Robne opcije koje se odnose na metale	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Robni ugovori o razmjeni koji se odnose na metale	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Robne budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na energente	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Robne opcije koje se odnose na energente	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Robni ugovori o razmjeni koji se odnose na energente	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Robne budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na poljoprivredne proizvode	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Robne opcije koje se odnose na poljoprivredne proizvode	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Robni ugovori o razmjeni koji se odnose na poljoprivredne proizvode	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Druge robne izvedenice	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR

▼B

8. **Valutne izvedenice**

▼M3

Tablica 8.1.

Valutne izvedenice – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – valutne izvedenice			
financijski instrument koji se odnosi na valute kako je definirano u odjeljku C točki 4. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU			
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti**	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Terminski ugovor bez isporuke (NDF) Terminski ugovor koji ugovorne strane, prema ugovornim uvjetima, namiruju u novcu, pri čemu se iznos za namiru utvrđuje na temelju razlike u tečaju dviju valuta na datum trgovanja i datum vrednovanja. Na datum namire jedna će strana drugoj strani dugovati neto razliku između i. tečaja na datum trgovanja i ii. tečaja na datum vrednovanja, na osnovi zamišljenog iznosa, i taj će se neto iznos isplatiti u valuti namire koja je utvrđena ugovorom. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FORW RTS2#26 = NDLV	Podrazred valutni terminski ugovor bez isporuke definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#13 i RTS23#47) – odnosni valutni par definiran je kao kombinacija dviju valuta koje su odnosni instrument ugovora o izvedenici **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća terminskog ugovora definirano je kako slijedi: **Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 tjedan **Razred dospijeća 2**: 1 tjedan < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca **Razred dospijeća 3**: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina **Razred dospijeća 4**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine **Razred dospijeća 5**: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … **Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	Smatra se da za terminske ugovore bez isporuke (NDF) ne postoji likvidno tržište.	

▼M3

Razred imovine – valutne izvedenice			
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti**	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Terminski ugovor s isporukom (DF) Terminski ugovor koji obuhvaća samo razmjenu dviju različitih valuta na određeni budući ugovoreni datum namire po fiksnoj stopi dogovorenoj pri sklapanju ugovora o razmjeni. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FORW RTS2#26 = DLVB	Podrazred valutni terminski ugovor s isporukom definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#13 i RTS23#47) – odnosni valutni par definiran je kao kombinacija dviju valuta koje su odnosni instrument ugovora o izvedenici **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća terminskog ugovora definirano je kako slijedi: **Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 tjedan **Razred dospijeća 2**: 1 tjedan < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca **Razred dospijeća 3**: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina **Razred dospijeća 4**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine **Razred dospijeća 5**: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … **Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	Smatra se da za terminske ugovore s isporukom ne postoji likvidno tržište.	

▼M3

Razred imovine – valutne izvedenice			
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti**	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Valutne opcije bez isporuke (NDO) Opcija koju ugovorne strane, prema ugovornim uvjetima, namiruju u novcu, pri čemu se iznos za namiru utvrđuje na temelju razlike u tečaju dviju valuta na datum trgovanja i datum vrednovanja. Na datum namire jedna će strana drugoj strani dugovati neto razliku između i. tečaja na datum trgovanja i ii. tečaja na datum vrednovanja, na osnovi zamišljenog iznosa, i taj će se neto iznos isplatiti u valuti namire koja je utvrđena ugovorom. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = OPTN RTS2#26 = NDLV	Podrazred valutna opcija bez isporuke definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#13 i RTS23#47) – odnosni valutni par definiran je kao kombinacija dviju valuta koje su odnosni instrument ugovora o izvedenici **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća opcije definirano je kako slijedi: **Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 tjedan **Razred dospijeća 2**: 1 tjedan < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca **Razred dospijeća 3**: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina **Razred dospijeća 4**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine **Razred dospijeća 5**: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … **Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	Smatra se da za valutne opcije bez isporuke (NDO) ne postoji likvidno tržište.	

▼M3

Razred imovine – valutne izvedenice			
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti**	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Valutne opcije s isporukom (DO) Opcija koja obuhvaća samo razmjenu dviju različitih valuta na određeni budući ugovoreni datum namire po fiksnoj stopi dogovorenoj pri sklapanju ugovora o razmjeni. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = OPTN RTS2#26 = DLVB	podrazred valutna opcija s isporukom definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#13 i RTS23#47) – odnosni valutni par definiran je kao kombinacija dviju valuta koje su odnosni instrument ugovora o izvedenici **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća opcije definirano je kako slijedi: **Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 tjedan **Razred dospijeća 2**: 1 tjedan < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca **Razred dospijeća 3**: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina **Razred dospijeća 4**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine **Razred dospijeća 5**: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … **Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	Smatra se da za valutne opcije s isporukom (DO) ne postoji likvidno tržište.	

▼M3

Razred imovine – valutne izvedenice			
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti**	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Valutni ugovori o razmjeni bez isporuke (NDS) Ugovor o razmjeni koji ugovorne strane, prema ugovornim uvjetima, namiruju u novcu, pri čemu se iznos za namiru utvrđuje na temelju razlike u tečaju dviju valuta na datum trgovanja i datum vrednovanja. Na datum namire jedna će strana drugoj strani dugovati neto razliku između i. tečaja na datum trgovanja i ii. tečaja na datum vrednovanja, na osnovi zamišljenog iznosa, i taj će se neto iznos isplatiti u valuti namire koja je utvrđena ugovorom. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = SWAP RTS2#26 = NDLV	podrazred valutni ugovori o razmjeni bez isporuke definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#13 i RTS23#47) – odnosni valutni par definiran je kao kombinacija dviju valuta koje su odnosni instrument ugovora o izvedenici **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi: **Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 tjedan **Razred dospijeća 2**: 1 tjedan < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca **Razred dospijeća 3**: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina **Razred dospijeća 4**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine **Razred dospijeća 5**: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … **Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	Smatra se da za valutne ugovore o razmjeni bez isporuke ne postoji likvidno tržište.	

▼M3

Razred imovine – valutne izvedenice			
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti**	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Valutni ugovori o razmjeni s isporukom (DS) Ugovor o razmjeni koji obuhvaća samo razmjenu dviju različitih valuta na određeni budući ugovoreni datum namire po fiksnoj stopi dogovorenoj pri sklapanju ugovora o razmjeni. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = SWAP RTS2#26 = DLVB	Podrazred valutni ugovori o razmjeni s isporukom definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#13 i RTS23#47) – odnosni valutni par definiran je kao kombinacija dviju valuta koje su odnosni instrument ugovora o izvedenici **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi: **Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 tjedan **Razred dospijeća 2**: 1 tjedan < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca **Razred dospijeća 3**: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina **Razred dospijeća 4**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine **Razred dospijeća 5**: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … **Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	Smatra se da za ostvarive valutne ugovore o razmjeni ne postoji likvidno tržište.	

▼M3

Razred imovine – valutne izvedenice			
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti**	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Valutne budućnosnice **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = FUTR	Podrazred valutne budućnosnice definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#13 i RTS23#47) – odnosni valutni par definiran je kao kombinacija dviju valuta koje su odnosni instrument ugovora o izvedenici **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća budućnosnice definirano je kako slijedi: **Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 tjedan **Razred dospijeća 2**: 1 tjedan < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca **Razred dospijeća 3**: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina **Razred dospijeća 4**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine **Razred dospijeća 5**: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … **Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	Smatra se da za valutne budućnosnice ne postoji likvidno tržište.	

Razred imovine – valutne izvedenice	
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija**
Druge valutne izvedenice valutna izvedenica koja ne pripada ni u jedan od prethodno navedenih podrazreda imovine RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = OTHR	Smatra se da za sve druge valutne izvedenice ne postoji likvidno tržište.

▼M4

Tablica 8.2.

Valutne izvedenice – pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – valutne izvedenice			
Podrazred imovine	**Pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište**		
	LIS prije trgovanja	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
	Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
Terminski ugovor bez isporuke (NDF)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Terminski ugovor s isporukom (DF)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Valutne opcije bez isporuke (NDO)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Valutne opcije s isporukom (DO)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Valutni ugovori o razmjeni bez isporuke (NDS)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Valutni ugovori o razmjeni s isporukom (DS)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Valutne budućnosnice	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Druge valutne izvedenice	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR

▼B

9. **Kreditne izvedenice**

▼M3

Tablica 9.1.

Kreditne izvedenice – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – kreditne izvedenice				
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji**		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Status indeksa *on-the-run*** [Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti]
Indeksni ugovor o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza (CDS) u kojem je razmjena novčanih tokova povezana s kreditnom sposobnosti nekoliko izdavatelja financijskih instrumenata koji čine indeks i nastankom kreditnih događaja **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	Podrazred indeksni ugovori o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS2#34) – odnosni indeks **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#42) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa izvedenice **Kriterij segmentacije 3** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća CDS-a definirano je kako slijedi: **Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina **Razred dospijeća 2**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine **Razred dospijeća 3**: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … **Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	200 000 000 EUR	10	Smatra se da za odnosni indeks postoji likvidno tržište. (1) tijekom cijelog razdoblja statusa *on-the-run* (2) prvih 30 radnih dana statusa *1x off-the-run* Status indeksa *on-the-run* označava najnoviju tekuću verziju (seriju) indeksa kreiranu na datum kad sastav indeksa počinje važiti, a koja završava na dan koji prethodi datumu kad sastav sljedeće verzije (serije) indeksa počinje važiti. Status *1x off-the-run* označava verziju (seriju) indeksa koja neposredno prethodi tekućoj *on-the-run* verziji (seriji) u određenom trenutku. Verzija (serija) prestaje imati status on-the-run te stječe status 1x off-the-run nakon što se kreira posljednja verzija (serija) indeksa.

▼M3

Razred imovine – kreditne izvedenice				
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji**		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Status indeksa *on-the-run*** [Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti]
Ugovor o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza (CDS) jednog subjekta u kojem je razmjena novčanih tokova povezana s kreditnom sposobnosti jednog izdavatelja financijskih instrumenata i nastankom kreditnih događaja **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	Podrazred ugovori o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza jednog subjekta definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS2#41) – odnosni referentni subjekt **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#39) – vrsta odnosnog referentnog subjekta definirana je kako slijedi: „Državni ili javni izdavatelj” znači jedan od sljedećih subjekata: (a) Unija; (b) država članica uključujući ministarstvo, agenciju ili subjekt posebne namjene države članice; (c) državni subjekt koji nije naveden u točkama (a) i (b); (d) u slučaju federalne države članice, član te federacije; (e) subjekt posebne namjene za nekoliko država članica; (f) međunarodna financijska institucija koju su osnovale dvije ili više država članica, čija je svrha mobilizirati sredstva i pružiti financijsku pomoć u korist svojih članova koji imaju ili im prijete ozbiljne financijske poteškoće;	10 000 000 EUR	10	

▼M3

Razred imovine – kreditne izvedenice				
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji**		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Status indeksa *on-the-run*** [Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti]
	(g) Europska investicijska banka; (h) javno tijelo koje nije državni izdavatelj kako je navedeno u točkama (a) do (c). „Korporativni izdavatelj" znači subjekt koji je izdavatelj, ali koji nije državni ili javni izdavatelj. **Kriterij segmentacije 3** (RTS2#42) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa izvedenice **Kriterij segmentacije 4** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća CDS-a definirano je kako slijedi: **Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina **Razred dospijeća 2**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine **Razred dospijeća 3**: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … **Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina			
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže sljedeće kvantitativne kriterije likvidnosti**		
Opcija na indeks CDS-a je opcija čiji je odnosni instrument indeks CDS-ova	Podrazred opcija na indeks CDS-a definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:	Smatra se da likvidno tržište postoji za opciju na indeks CDS-a čiji je odnosni instrument indeks CDS-a koji se smatra podrazredom za koji je utvrđeno da likvidno tržište postoji i čije je vrijeme do razreda dospijeća od 0 do 6 mjeseci.		

▼M3

Razred imovine – kreditne izvedenice				
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji**		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Status indeksa *on-the-run*** [Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti]
RTS2#3 = DERV **RTS2#4 = CRDT**	**Kriterij segmentacije 1** (RTS23#26) – podrazred indeksa CDS-a kako je definirano za podrazred imovine indeksni ugovori o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza (CDS) **Kriterij segmentacije 2** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća opcije definirano je kako slijedi: **Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci **Razred dospijeća 2**: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina **Razred dospijeća 3**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine **Razred dospijeća 4**: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … **Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	Smatra se da likvidno tržište ne postoji za opciju na indeks CDS-a čiji je odnosni instrument indeks CDS-a koji se smatra podrazredom za koji je utvrđeno da likvidno tržište postoji i čije vrijeme do razreda dospijeća nije 0 do 6 mjeseci. Smatra se da likvidno tržište ne postoji za opciju na indeks CDS-a čiji je odnosni instrument indeks CDS-a koji se smatra podrazredom za koji je utvrđeno da likvidno tržište ne postoji u odnosu na bilo koji razred dospijeća.		
Opcija na CDS jednog subjekta je opcija čiji je odnosni instrument CDS jednog subjekta **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	podrazred opcije na CDS jednog subjekta definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS23#26) – podrazred CDS jednog subjekta kako je definirano za podrazred imovine CDS jednog subjekta	Smatra se da likvidno tržište postoji za opciju na CDS jednog subjekta čiji je odnosni instrument CDS jednog subjekta koji se smatra podrazredom za koji je utvrđeno da likvidno tržište postoji i čije je vrijeme do razreda dospijeća od 0 do 6 mjeseci. Smatra se da likvidno tržište ne postoji za opciju na CDS jednog subjekta čiji je odnosni instrument CDS jednog subjekta koji se smatra podrazredom za koji je utvrđeno da likvidno tržište postoji i čije vrijeme do razreda dospijeća nije od 0 do 6 mjeseci.		

▼M3

Razred imovine – kreditne izvedenice				
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji**		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	**Status indeksa *on-the-run*** [Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti]
	Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća opcije definirano je kako slijedi: **Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci **Razred dospijeća 2**: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina **Razred dospijeća 3**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine **Razred dospijeća 4**: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … **Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	Smatra se da likvidno tržište ne postoji za opciju na CDS jednog subjekta čiji je odnosni instrument CDS jednog subjekta koji se smatra podrazredom za koji je utvrđeno da likvidno tržište ne postoji u odnosu na bilo koji razred dospijeća.		

Razred imovine – kreditne izvedenice	
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija**
Druge kreditne izvedenice su kreditne izvedenice koje ne pripadaju ni u jedan od prethodno navedenih podrazreda imovine **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT** RTS2#5 = OTHR	Smatra se da za sve druge kreditne izvedenice ne postoji likvidno tržište.

▼M4

Tablica 9.2.

Kreditne izvedenice – pragovi za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da postoji likvidno tržište

Razred imovine – kreditne izvedenice									
Podrazred imovine	**Percentili i donji pragovi koji se primjenjuju za izračun pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da postoji likvidno tržište**								
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova	**LIS prije trgovanja**		**SSTI poslije trgovanja**			**LIS poslije trgovanja**		
		Trgovanje – percentil	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**
Indeksni ugovori o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza (CDS)	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Ugovori o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza (CDS) jednog subjekta	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Opcije na indeks CDS-a	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Razred imovine – kreditne izvedenice									
Podrazred imovine	**Percentili i donji pragovi koji se primjenjuju za izračun pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da postoji likvidno tržište**								
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova	**LIS prije trgovanja**		**SSTI poslije trgovanja**			**LIS poslije trgovanja**		
		Trgovanje – percentil	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**
Opcije na CDS jednog subjekta	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

Tablica 9.3.

Kreditne izvedenice – pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – kreditne izvedenice			
Podrazred imovine	**Pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište**		
	LIS prije trgovanja	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
	Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
Indeksni ugovori o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza (CDS)	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Ugovori o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza (CDS) jednog subjekta	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Opcije na indeks CDS-a	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Opcije na CDS jednog subjekta	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Druge kreditne izvedenice	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR

▼B

10. **C10 izvedenice**

▼M3

Tablica 10.1.

C10 izvedenice – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – C10 izvedenice			
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti**	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Izvedenice koje se odnose na vozarine Financijski instrument koji se odnosi na vozarine kako je definirano u odjeljku C točki 10. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS23#35 = FRGT	Podrazred izvedenica koje se odnose na vozarine definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: **Kriterij segmentacije 1** (RTS2#5) – vrsta ugovora: budućnosnice ili opcije **Kriterij segmentacije 2** (RTS23#36) – vrsta tereta **Kriterij segmentacije 3** (RTS2#37) – podvrsta tereta **Kriterij segmentacije 4** (RTS2#12) – naznaka veličine koja se odnosi na podvrstu tereta **Kriterij segmentacije 5** (RTS2#13) – određena linija ili zakup na određeno vrijeme **Kriterij segmentacije 6** (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća izvedenice definirano je kako slijedi: **Razred dospijeća 1**: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec **Razred dospijeća 2**: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca **Razred dospijeća 3**: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci **Razred dospijeća 4**: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 9 mjeseci **Razred dospijeća 5**: 9 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina **Razred dospijeća 6**: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine	10 000 000 EUR	10

▼M3

Razred imovine – C10 izvedenice			
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti**	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
	Razred dospijeća 7: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine … **Razred dospijeća m**: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina		

Razred imovine – C10 izvedenice	
Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija**
Druge C10 izvedenice Financijski instrument kako je definiran u odjeljku C točki 10. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU koji nije „izvedenica koja se odnosi na vozarine”, jedan od sljedećih podrazreda imovine kamatnih izvedenica: inflacijski viševalutni ili međuvalutni ugovor o razmjeni, budućnosnica/terminski ugovor koji se odnose na inflacijske viševalutne ili međuvalutne ugovore o razmjeni, inflacijski jednovalutni ugovori o razmjeni, budućnosnica/terminski ugovor koji se odnose na inflacijske jednovalutne ugovore o razmjeni i jedan od sljedećih podrazreda imovine vlasničkih izvedenica: opcija na indeks volatilnosti, budućnosnica/terminski ugovor koji se odnosi na indeks volatilnosti, ugovori o razmjeni s rezultatom na osnovi varijance, ugovori o razmjeni s rezultatom na osnovi volatilnosti, ugovori o razmjeni na razini portfelja s rezultatom na osnovi varijance, ugovori o razmjeni na razini portfelja s rezultatom na osnovi volatilnosti	Smatra se da za sve druge C10 izvedenice ne postoji likvidno tržište.

▼M4

Tablica 10.2.

C10 izvedenice – pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da postoji likvidno tržište

Razred imovine – C10 izvedenice									
Podrazred imovine	**Percentili i donji pragovi koji se primjenjuju za izračun pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da postoji likvidno tržište**								
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova	**LIS prije trgovanja**		**SSTI poslije trgovanja**			**LIS poslije trgovanja**		
		Trgovanje – percentil	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**
Izvedenice koje se odnose na vozarine	Pragove bi trebalo izračunati za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir izvršene transakcije financijskim instrumentima koji pripadaju tom podrazredu.	70	50 000 EUR	80	60	75 000 EUR	90	70	100 000 EUR

Tablica 10.3.

C10 izvedenice – pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – C10 izvedenice			
Podrazred imovine	**Pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište**		
	LIS prije trgovanja	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
	Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
Izvedenice koje se odnose na vozarine	50 000 EUR	75 000 EUR	100 000 EUR
Druge C10 izvedenice	50 000 EUR	75 000 EUR	100 000 EUR

▼B

11. **Financijski ugovori za razlike (CFD)**

▼M3

Tablica 11.1.

CFD-i – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Podrazred imovine	**Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku**	Kvalitativni kriterij likvidnosti	**Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)** [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Valutni CFD-i RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = CURR	Podrazred valutni CFD definiran je kao odnosni valutni par definiran kao kombinacija dviju valuta koje su odnosni instrument CFD-a/ugovora o okladama na raspone RTS2#30 i RTS2#31		50 000 000 EUR	100
Roba CFD-i RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = COMM	Podrazred robni CFD-i definiran je kao odnosna roba CFD-a/ugovora o okladama na raspone RTS23#35 i RTS23#36 i RTS23#37		50 000 000 EUR	100
Vlasnički CFD-i RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = EQUI	Podrazred vlasnički CFD-i definiran je kao odnosni vlasnički vrijednosni papir CFD-a/ugovora o okladama na raspone RTS23#26	Smatra se da za podrazred vlasnički CFD-i postoji likvidno tržište ako je odnosni instrument vlasnički vrijednosni papir za koji postoji likvidno tržište kako je utvrđeno u skladu s člankom 2. stavkom 1. točkom 17. podtočkom (b) Uredbe (EU) br. 600/2014		
CFD-i koji se odnose na obveznice RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = BOND	Podrazred CFD-i koji se odnose na obveznice definiran je kao odnosna obveznica ili obveznička budućnosnica za CFD-e/ugovore o okladama na raspone RTS23#26	Smatra se da za podrazred CFD-i koji se odnose na obveznice postoji likvidno tržište ako je odnosni instrument obveznica ili obveznička budućnosnica za koji postoji likvidno tržište kako je utvrđeno u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b).		

▼M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Kvalitativni kriterij likvidnosti	Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
CFD-i koji se odnose na vlasničke budućnosnice/ terminske ugovore RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = FTEQ	Podrazred CFD-i koji se odnose na vlasničke budućnosnice/ terminske ugovore definiran je kao odnosna budućnosnica/ terminski ugovor koji se odnosi na vlasnički vrijednosni papir za CFD-e/ugovore o okladama na raspone RTS23#26	Smatra se da za podrazred CFD-i koji se odnose na vlasničke budućnosnice/ terminske ugovore postoji likvidno tržište ako je odnosni instrument vlasnička budućnosnica/terminski ugovor za koji postoji likvidno tržište kako je utvrđeno u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b).		
CFD-i koji se odnose na vlasničke opcije RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OPEQ	Podrazred CFD-i koji se odnose na vlasničke opcije definiran je kao odnosna opcija na vlasnički vrijednosni papir za CFD-e/ugovore o okladama na raspone RTS23#26	Smatra se da za podrazred CFD-i koji se odnose na vlasničke opcije postoji likvidno tržište ako je odnosni instrument vlasnička opcija za koji postoji likvidno tržište kako je utvrđeno u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b).		

Razred imovine – financijski ugovori za razlike (CFD)

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija
Drugi CFD-i	
CFD/ugovor o okladama na raspone koji ne pripada ni u jedan od prethodno navedenih podrazreda imovine RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OTHR	Smatra se da za sve druge CFD-e/ugovore o okladama na raspone ne postoji likvidno tržište.

▼M4

Tablica 11.2.

CFD-i – pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da postoji likvidno tržište

Razred imovine – financijski ugovori za razlike (CFD-i)									
Podrazred imovine	**Percentili i donji pragovi koji se primjenjuju za izračun pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da postoji likvidno tržište**								
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova	**LIS prije trgovanja**		**SSTI poslije trgovanja**			**LIS poslije trgovanja**		
		Trgovanje – percentil	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**
Valutni CFD-i	Izvršene transakcije valutnim CFD-ima za koje se smatra da postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b)	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Robni CFD-i	Izvršene transakcije robnim CFD-ima za koje se smatra da postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b)	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Vlasnički CFD-i	Izvršene transakcije vlasničkim CFD-ima za koje se smatra da postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b)	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Obveznički CFD-i	Izvršene transakcije vlasničkim CFD-ima za koje se smatra da postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b)	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR

▼M4

Razred imovine – financijski ugovori za razlike (CFD-i)									
Podrazred imovine	**Percentili i donji pragovi koji se primjenjuju za izračun pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da postoji likvidno tržište**								
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova	**LIS prije trgovanja**		**SSTI poslije trgovanja**			**LIS poslije trgovanja**		
		Trgovanje – percentil	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Volumen – percentil**	**Donji prag**
CFD-i koji se odnose na vlasničke budućnosnice / terminske ugovore	Izvršene transakcije CFD-ima koji se odnose na vlasničke budućnosnice za koje se smatra da postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b)	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
CFD-i koji se odnose na vlasničke opcije	Izvršene transakcije CFD-ima koji se odnose na vlasničke opcije za koje se smatra da postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b)	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR

Tablica 11.3.

CFD-i – pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – financijski ugovori za razlike (CFD-i)			
Podrazred imovine	**Pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište**		
	LIS prije trgovanja	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
	Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
Valutni CFD-i	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Robni CFD-i	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

▼M4

Razred imovine – financijski ugovori za razlike (CFD-i)			
Podrazred imovine	**Pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište**		
	LIS prije trgovanja	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
	Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
Vlasnički CFD-i	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Obvezнички CFD-i	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
CFD-i koji se odnose na vlasničke budućnosnice / terminske ugovore	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
CFD-i koji se odnose na vlasničke opcije	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Drugi CFD-i / ugovori o okladama na raspone	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

12. **Emisijske jedinice**

Tablica 12.1.

Emisijske jedinice – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – emisijske jedinice	
Za potrebe utvrđivanja podrazreda imovine za koje ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6.a primjenjuje se sljedeća metodologija:	
Podrazred imovine	**Utvrđivanje likvidnosti**
Emisijske jedinice Europske unije (EUA): svaka jedinica kojoj se priznaje usklađenost sa zahtjevima Direktive 2003/87/EZ Europskog parlamenta i Vijeća [1] (sustav trgovanja emisijskim jedinicama) i koja označava pravo na emisiju jedne tone ekvivalenta ugljikova dioksida (tCO_2e) RTS2#3 = EMAL i RTS23#37 = EUAE	Za emisijske jedinice Europske unije smatra se da postoji likvidno tržište.
Sve ostale emisijske jedinice RTS2#3 = EMAL i RTS23#37 <> EUAE	Za sve ostale emisijske jedinice smatra se da ne postoji likvidno tržište.

[1] Direktiva 2003/87/EZ Europskog parlamenta i Vijeća od 13. listopada 2003. o uspostavi sustava trgovanja emisijskim jedinicama stakleničkih plinova unutar Zajednice i o izmjeni Direktive Vijeća 96/61/EZ (SL L 275, 25.10.2003., str. 32., ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2003/87/oj).

▼M4

Tablica 12.2.

Emisijske jedinice – prag za LIS prije trgovanja i veličinu poslije trgovanja

Razred imovine – emisijske jedinice		
Podrazred imovine	**LIS prije trgovanja**	**Prag za veličinu poslije trgovanja**
Emisijske jedinice Europske unije (EUA)	5 000 tona ekvivalenta ugljikova dioksida	25 000 tona ekvivalenta ugljikova dioksida
Sve ostale emisijske jedinice	Bilo koja veličina	Bilo koja veličina

▼B

13. **Izvedenice emisijskih jedinica**

▼M3

Tablica 13.1.

Izvedenice na emisijske jedinice – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

	Razred imovine – izvedenice na emisijske jedinice	
Podrazred imovine	**Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti**	
	Prosječni dnevni iznos (ADA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Izvedenice na emisijske jedinice koje kao odnosni instrument imaju emisijske jedinice Europske unije (EUA) Financijski instrument koji se odnosi na emisijske jedinice Europske unije (EUA) kako je definirano u odjeljku C točki 4. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = EMAL i RTS2#43 = EUAE	150 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	5

▼M3

Podrazred imovine	Razred imovine – izvedenice na emisijske jedinice	
	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
	Prosječni dnevni iznos (ADA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	**Prosječni dnevni broj transakcija** [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Izvedenice na emisijske jedinice koje kao odnosni instrument imaju zrakoplovne emisijske jedinice Europske unije (EUAA) Financijski instrument koji se odnosi na zrakoplovne emisijske jedinice Europske unije (EUAA) kako je definirano u odjeljku C točki 4. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = EMAL i RTS2#43 = EUAA	150 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	5
Izvedenice na emisijske jedinice koje kao odnosni instrument imaju ovjerena smanjenja emisija (CER) Financijski instrument koji se odnosi na emisijske jedinice – ovjerena smanjenja emisija (CER) kako je definirano u odjeljku C točki 4. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = EMAL i RTS2#43 = CERE	150 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	5
Izvedenice na emisijske jedinice koje kao odnosni instrument imaju jedinice smanjenja emisija (ERU) Financijski instrument koji se odnosi na jedinice smanjenja emisija kako je definirano u odjeljku C točki 4. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = EMAL i RTS2#43 = ERUE	150 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	5
Ostale izvedenice na emisijske jedinice izvedenica na emisijske jedinice koja kao odnosni instrument ima emisijske jedinice kojima se priznaje usklađenost sa zahtjevima Direktive 2003/87/EZ (sustav trgovanja emisijskim jedinicama), a ne emisijske jedinice Europske unije (EUA), zrakoplovne emisijske jedinice Europske unije (EUAA), ovjerena smanjenja emisije (CER) i jedinice smanjenja emisija (ERU) RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = EMAL i RTS2#43 = OTHR	Smatra se da za druge izvedenice na emisijske jedinice ne postoji likvidno tržište.	

▼M4

Tablica 13.2.

Izvedenice na emisijske jedinice – pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da postoji likvidno tržište

Razred imovine – izvedenice na emisijske jedinice							
Podrazred imovine	**Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova**	**Percentili i donji pragovi koji se primjenjuju za izračun pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede imovine za koje se smatra da postoji likvidno tržište**					
		LIS prije trgovanja		**SSTI poslije trgovanja**		**LIS poslije trgovanja**	
		Trgovanje – percentil	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Donji prag**
Izvedenice na emisijske jedinice čiji su odnosni instrument emisijske jedinice Europske unije (EUA)	Izvršene transakcije svim izvedenicama na emisijske jedinice čiji su odnosni instrument emisijske jedinice Europske unije (EUA)	70	50 000 tona ugljikova dioksida	80	90 000 tona ugljikova dioksida	90	100 000 tona ugljikova dioksida
Izvedenice na emisijske jedinice čiji su odnosni instrument zrakoplovne emisijske jedinice Europske unije (EUAA)	Izvršene transakcije svim izvedenicama na emisijske jedinice čiji su odnosni instrument zrakoplovne emisijske jedinice Europske unije (EUAA)	70	25 000 tona ugljikova dioksida	80	40 000 tona ugljikova dioksida	90	50 000 tona ugljikova dioksida
Izvedenice na emisijske jedinice čiji su odnosni instrument ovjerena smanjenja emisija (CER)	Izvršene transakcije svim izvedenicama na emisijske jedinice čiji su odnosni instrument ovjerena smanjenja emisija (CER)	70	25 000 tona ugljikova dioksida	80	40 000 tona ugljikova dioksida	90	50 000 tona ugljikova dioksida

▼M4

Razred imovine – izvedenice na emisijske jedinice							
Podrazred imovine	**Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova**	**Percentili i donji pragovi koji se primjenjuju za izračun pragova za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede imovine za koje se smatra da postoji likvidno tržište**					
		LIS prije trgovanja		**SSTI poslije trgovanja**		**LIS poslije trgovanja**	
		Trgovanje – percentil	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Donji prag**	**Trgovanje – percentil**	**Donji prag**
Izvedenice na emisijske jedinice čiji su odnosni instrument jedinice smanjenja emisija (ERU)	Izvršene transakcije svim izvedenicama na emisijske jedinice čiji su odnosni instrument jedinice smanjenja emisija (ERU)	70	25 000 tona ugljikova dioksida	80	40 000 tona ugljikova dioksida	90	50 000 tona ugljikova dioksida

Tablica 13.3.

Izvedenice na emisijske jedinice – pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – izvedenice na emisijske jedinice			
Podrazred imovine	**Pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede imovine za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište**		
	LIS prije trgovanja	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
	Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
Izvedenice na emisijske jedinice čiji su odnosni instrument emisijske jedinice Europske unije (EUA)	50 000 tona ugljikova dioksida	90 000 tona ugljikova dioksida	100 000 tona ugljikova dioksida
Izvedenice na emisijske jedinice čiji su odnosni instrument zrakoplovne emisijske jedinice Europske unije (EUAA)	25 000 tona ugljikova dioksida	40 000 tona ugljikova dioksida	50 000 tona ugljikova dioksida

▼M4

Razred imovine – izvedenice na emisijske jedinice			
Podrazred imovine	**Pragovi za SSTI i LIS prije i poslije trgovanja za podrazrede imovine za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište**		
	LIS prije trgovanja	**SSTI poslije trgovanja**	**LIS poslije trgovanja**
	Granična vrijednost	**Granična vrijednost**	**Granična vrijednost**
Izvedenice na emisijske jedinice čiji su odnosni instrument ovjerena smanjenja emisija (CER)	25 000 tona ugljikova dioksida	40 000 tona ugljikova dioksida	50 000 tona ugljikova dioksida
Izvedenice na emisijske jedinice čiji su odnosni instrument jedinice smanjenja emisija (ERU)	25 000 tona ugljikova dioksida	40 000 tona ugljikova dioksida	50 000 tona ugljikova dioksida
Druge izvedenice na emisijske jedinice	25 000 tona ugljikova dioksida	40 000 tona ugljikova dioksida	50 000 tona ugljikova dioksida

▼B

PRILOG IV.

Referentni podaci koji se dostavljaju za potrebe izračuna povezanih s transparentnosti

▼M3
▼C1

Tablica 1.

Tablica s oznakama za tablicu 2.

OZNAKA	VRSTA PODATKA	DEFINICIJA
{ALPHANUM-n}	Najviše n alfanumeričkih znakova	Rubrika za slobodan unos teksta
{DECIMAL-n/m}	Decimalni broj od najviše n znamenki od kojih najviše m znamenki može biti dio decimale	Numeričko polje za pozitivne i negativne vrijednosti: 1. decimalni razdjelnik je „.” (točka); 2. ispred broja je moguće staviti „–” (minus) za označavanje negativnih brojeva. Vrijednosti se, prema potrebi, zaokružuju, a ne skraćuju.
{COUNTRYCODE_2}	2 alfanumerička znaka	Dvoslovna oznaka države, kako je definirano u alpha-2 kodu države u skladu s normom ISO 3166-1
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerička znaka	Troslovna valutna oznaka, kako je definirano u valutnim oznakama u skladu s normom ISO 4217
{DATEFORMAT}	Format datuma u skladu s normom ISO 8601	Datumi se navode u sljedećem formatu: GGGG-MM-DD
{ISIN}	12 alfanumeričkih znakova	Oznaka ISIN, kako je definirana normom ISO 6166
{LEI}	20 alfanumeričkih znakova	Identifikacijska oznaka pravnog subjekta kako je definirano normom ISO 17442
{MIC}	4 alfanumerička znaka	Identifikacijska oznaka tržišta, kako je definirano u normi ISO 10383
{EIC}	16 alfanumeričkih znakova	Oznaka EIC koja se odnosi na mjesto isporuke unutar ili izvan Europske unije
{INDEX}	4 slovna znaka	„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

OZNAKA	VRSTA PODATKA	DEFINICIJA
		„CIBO” – CIBOR „MOSP” – MOSPRIM „NIBO” – NIBOR „PRBO” – PRIBOR „TLBO” – TELBOR „WIBO” – WIBOR „TREA” – Riznica „SWAP” – Ugovor o razmjeni „FUSW” – Terminski ugovor o razmjeni

▼M3

Tablica 2

Pojedinosti o referentnim podacima koji se dostavljaju za izračune za potrebe transparentnosti

Br.	RUBRIKA	POJEDINOSTI KOJE SE DOSTAVLJAJU	FORMAT ZA IZVJEŠĆIVANJE
1	Identifikacijska oznaka instrumenta	Oznaka za identifikaciju financijskog instrumenta	{ISIN}
2	Puni naziv instrumenta	Puni naziv financijskog instrumenta	{ALPHANUM-350}
3	Identifikator MiFIR	**Identifikacija nevlasničkih financijskih instrumenata** **Sekuritizirane izvedenice** kako su definirane u odjeljku 4. tablici 4.1 Priloga III. **Strukturirani financijski proizvodi (SFP)** kako je definirano u članku 2. stavku 1. točki 28. Uredbe (EU) br. 600/2014 **Obveznice (za sve obveznice osim ETC-a i ETN-a)** kako je definirano u članku 4. stavku 1. točki 44. podtočki (b) Direktive 2014/65/EU **ETC-i** kako je definirano u članku 4. stavku 1. točki 44. podtočki (b) Direktive 2014/65/EU i dodatno utvrđeno u odjeljku 2. tablici 2.4 Priloga III. **ETN-i** kako je definirano u članku 4. stavku 1. točki 44. podtočki (b) Direktive 2014/65/EU i dodatno utvrđeno u odjeljku 2. tablici 2.4 Priloga III. **Emisijske jedinice** kako je definirano u odjeljku 12. tablici 12.1 Priloga III. **Izvedenice** kako je definirano u odjeljku C točkama 4. do 10. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU	**Nevlasnički financijski instrumenti:** „SDRV” – sekuritizirane izvedenice „SFPS” – strukturirani financijski proizvodi (SFP) „BOND” – obveznice „ETCS” – ETC-i „ETNS” – ETN-i „EMAL” – emisijske jedinice „DERV” – izvedenica

▼M3

Br.	RUBRIKA	POJEDINOSTI KOJE SE DOSTAVLJAJU	FORMAT ZA IZVJEŠĆIVANJE
4	Razred imovine odnosnog instrumenta	Ispunjava se kad je identifikator MiFIR sekuritizirana izvedenica ili izvedenica.	„INTR” – kamatna stopa „EQUI” – vlasnički vrijednosni papir „COMM” – roba „CRDT” – kredit „CURR” – valuta „EMAL” – emisijske jedinice „OCTN” – druge C10
5	Vrsta ugovora	Ispunjava se kad je identifikator MiFIR izvedenica.	„OPTN” – opcije „FRAS” – budućnosnice (uključujući terminske ugovore koji se odnose na vozarine (FFA)) „FRAS” – terminski ugovor o kamatnoj stopi (FRA) „FORW” – terminski ugovori „SWAP” – ugovori o razmjeni „PSWP” – ugovori o razmjeni na razini portfelja „SWPT” – opcije razmjene „OPTS” – opcija koja se odnosi na ugovor o razmjeni „FONS” – budućnosnice koje se odnose na ugovore o razmjeni „FWOS” – terminski ugovori koji se odnose na ugovore o razmjeni SPDB – oklade na raspone CFDS – CFD „OTHR” – drugo
6	Datum izvješćivanja	Dan za koji se dostavljaju referentni podaci	{DATEFORMAT}
7	Mjesto trgovanja	MIC segmenta za mjesto trgovanja ako je dostupan, u protivnom operativni MIC.	{MIC}
8	Dospijeće	Definirano dospijeća financijskog instrumenta. Ova se rubrika primjenjuje na razrede imovine: obveznice, kamatne izvedenice, vlasničke izvedenice, robne izvedenice, valutne izvedenice, kreditne izvedenice, C10 izvedenice i izvedenice emisijskih jedinica.	{DATEFORMAT}

Rubrike koje se odnose na obveznice (sve vrste obveznica osim ETC-a i ETN-a)

Rubrike u ovom odjeljku ispunjavaju se samo za emisijske jedinice kako je definirano u odjeljku 2. tablici 2.1 Priloga III.

9	Vrsta obveznice	Vrsta obveznice kako je utvrđeno u odjeljku 2. tablici 2.2 Priloga III. Rubrika se ispunjava kad su obveznice identifikator MiFIR.	„EUSB” – državne obveznice „OEPB” – druge obveznice javnog sektora „CVTB” – konvertibilne obveznice „CVDB” – pokrivene obveznice „CRPB” – korporativne obveznice „OTHR” – drugo

▼M3

10	Datum izdavanja	Datum izdavanja obveznice i početak obračunavanja kamate.	{DATEFORMAT}

Rubrike koje se odnose na emisijske jedinice

Rubrike u ovom odjeljku ispunjavaju se samo za emisijske jedinice kako je definirano u odjeljku 12. tablici 12.1 Priloga III.

11	Podvrsta emisijskih jedinica	Emisijske jedinice	„CERE” – CER „ERUE” – ERU „EUAE” – EUA „EUAA” – EUAA „OTHR” – drugo

Rubrike koje se odnose na izvedenice

Robne izvedenice i C10 izvedenice

Rubrike u ovom odjeljku ispunjavaju se samo za robne izvedenice kako je definirano u odjeljku 7. tablici 7.1 Priloga III. i za izvedenice C10, kako je definirano u odjeljku 10. tablici 10.1 Priloga III.

12	Naznaka veličine koja se odnosi na podvrstu tereta	Rubrika se ispunjava ako je teret osnovni proizvod utvrđen u rubrici 35 u tablici 2 Priloga Delegiranoj uredbi Komisije (EU) 2017/585.	Za suhi teret: „CAPE” – Capesize „PNMX” – Panamax „SPMX” – Supramax „HAND” – Handysize Za mokri teret: „CLAN” – čist (*clean*) „DRTY” – nečist (*dirty*) u protivnom {ALPHANUM-4}
13	Određena linija ili prosječni zakup na određeno vrijeme	Rubrika se ispunjava ako je teret osnovni proizvod utvrđen u rubrici 35 u tablici 2 Priloga Delegiranoj uredbi Komisije (EU) 2017/585.	Za mokri teret: „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

			Za suhi teret: „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 u protivnom {ALPHANUM-6}
14	Mjesto isporuke/ namire u novcu	Rubrika se ispunjava kad je energent osnovni proizvod koji je utvrđen u rubrici 35 u tablici 2 Priloga Delegiranoj uredbi Komisije (EU) 2017/585.	{EIC} za električnu energiju ili prirodni plin „OTHR” – drugo
15	Valuta zamišljene vrijednosti	Valuta u kojoj je zamišljena vrijednost denominirana.	{CURRENCYCODE_3}

Kamatne izvedenice

Rubrike u ovom odjeljku ispunjavaju se samo za kamatne izvedenice kako je definirano u odjeljku 5. tablici 5.1 Priloga III.

16	Vrsta odnosnog instrumenta	Za vrste ugovora osim ugovora o razmjeni, opcija razmjene, budućnosnica koje se odnose na ugovore o razmjeni i terminskih ugovora koji se odnose na ugovore o razmjeni rubrike se ispunjavaju sljedećim alternativnim rješenjima **********-********** Za ugovore o razmjeni, opcije razmjene, opcije koje se odnose na ugovore o razmjeni, budućnosnice i terminske ugovore koji se odnose na ugovore o razmjeni za odnosni ugovor o razmjeni upisuje se nešto od sljedećeg:	„BOND” – obveznica „BNDF” – obvezničke budućnosnice „INTR” – kamatna stopa „IFUT” – kamatne budućnosnice ********** „FFMC” – VIŠEVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI PROMJENJIVE ZA PROMJENJIVU KAMATNU STOPU „XFMC” – VIŠEVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI FIKSNE ZA PROMJENJIVU KAMATNU STOPU „XXMC” – VIŠEVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI FIKSNE ZA FIKSNU KAMATNU STOPU „OSMC” – PREKONOĆNI KAMATNI VIŠEVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI „IFMC” – INFLACIJSKI VIŠEVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI „FFSC” – JEDNOVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI PROMJENJIVE ZA PROMJENJIVU KAMATNU STOPU „XFSC” – JEDNOVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI FIKSNE ZA PROMJENJIVU KAMATNU STOPU

▼**M3**

			„XXSC” – JEDNOVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI FIKSNE ZA FIKSNU KAMATNU STOPU „OSSC” – PREKONOĆNI KAMATNI JEDNOVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI „IFSC” – INFLACIJSKI JEDNOVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI
17	Izdavatelj odnosne obveznice	Kad je odnosni instrument obveznica ili obveznička budućnosnica u rubrici se navodi oznaka identifikatora pravnog subjekta (LEI) izdavatelja izravne ili krajnje odnosne obveznice.	{LEI}
18	Datum dospijeća odnosne obveznice	U rubrici se navodi datum definiranog dospijeća odnosne obveznice.	{DATEFORMAT}
19	Datum izdavanja odnosne obveznice	U rubrici se navodi datum izdavanja odnosne obveznice.	{DATEFORMAT}
20	Valuta zamišljene vrijednosti opcije razmjene	Rubrika se ispunjava samo za opcije razmjene.	{CURRENCYCODE_3}
21	Dospijeće odnosnog ugovora o razmjeni	Rubrika se ispunjava samo za opcije razmjene, budućnosnice/terminske ugovore koji se odnose na ugovore o razmjeni.	{DATEFORMAT}
22	Oznaka ISIN inflacijskog indeksa / oznaka ISIN odnosne obveznice	U slučaju opcija razmjene na jednu od sljedećih vrsta odnosnih ugovora o razmjeni: inflacijski jednovalutni ugovor o razmjeni, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na inflacijski jednovalutni ugovor o razmjeni, inflacijski viševalutni ugovor o razmjeni, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na inflacijski viševalutni ugovor o razmjeni; kad inflacijski indeks ima ISIN, u rubrici se navodi oznaka ISIN tog indeksa. ********** U slučaju obvezničkih opcija / opcija na obvezničku opciju / opcija na obvezničku budućnosnicu, u rubriku se upisuje oznaka ISIN krajnje odnosne obveznice.	{ISIN} ********** {ISIN}

▼M3

23	Naziv inflacijskog indeksa	U rubrici se navodi standardizirani naziv indeksa u slučaju opcija razmjene na jednu od sljedećih vrsta odnosnih ugovora o razmjeni: inflacijski jednovalutni ugovor o razmjeni, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na inflacijski jednovalutni ugovor o razmjeni, inflacijski viševalutni ugovor o razmjeni, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na inflacijski viševalutni ugovor o razmjeni.	{ALPHANUM-25}
24	Referentna stopa	Naziv referentne stope	{INDEX} ili {ALPHANUM-25} – ako referentna stopa nije uvrštena u popis {INDEX}
25	Rok odnosne kamatne stope	U ovoj se rubrici navodi rok odnosne kamatne stope iz ugovora. Rok se iskazuje u danima, tjednima, mjesecima ili godinama. Iskazuje se počevši od najveće jedinice (godine) pa do najmanje; u ovoj rubrici iskazuje se standardni rok kamatne stope koji je cijeli broj.	{INTEGER-3}+„DAYS” – dani {INTEGER-3}+„WEEK” – tjedni {INTEGER-3}+„MNTH” – mjeseci {INTEGER-3}+„YEAR” – godine

Valutne izvedenice

Rubrike u ovom odjeljku ispunjavaju se samo za valutne izvedenice kako je definirano u odjeljku 8. tablici 8.1 Priloga III.

26	Podvrsta ugovora	Rubrika se ispunjava kako bi se razlikovali terminski ugovori, opcije i opcije razmjene s isporukom i bez isporuke kako je definirano u odjeljku 8. tablici 8.1 Priloga III.	„DLVB” – s isporukom „NDLV” – bez isporuke

Vlasničke izvedenice

Rubrike u ovom odjeljku ispunjavaju se samo za vlasničke izvedenice kako je definirano u odjeljku 6. tablici 6.1 Priloga III.

27	Vrsta odnosnog instrumenta	ispunjava se kad je identifikator MiFIR izvedenica, razred imovine odnosnog instrumenta jest vlasnički vrijednosni papir, a podrazred imovine nije ugovor o razmjeni ni ugovor o razmjeni na razini portfelja.	„STIX” – dionički indeks „SHRS” – dionica „DIVI” – indeks dividendi „DVSE” – dividenda dionice „BSKT” – košarica dionica koja proizlazi iz korporativne akcije „ETFS” – ETF-i „VOLI” – indeks volatilnosti „OTHR” – drugo (uključujući potvrde o deponiranim vrijednosnim papirima, certifikate i druge financijske instrumente kao što su vlasnički)

▼M3

		********** ispunjava se kad je identifikator MiFIR izvedenica, razred imovine odnosnog instrumenta vlasnički vrijednosni papir, podrazred imovine ugovor o razmjeni ili ugovor o razmjeni na razini portfelja, a kriterij segmentacije 2 je jedan subjekt kako je definirano u odjeljku 6. tablici 6.1 Priloga III.	********** „SHRS” – dionica „DVSE” – dividenda dionice „ETFS” – ETF-i „OTHR” – drugo (uključujući potvrde o deponiranim vrijednosnim papirima, certifikate i druge financijske instrumente kao što su vlasnički)
		********** ispunjava se kad je identifikator MiFIR izvedenica, razred imovine odnosnog instrumenta vlasnički vrijednosni papir, podrazred imovine ugovor o razmjeni ili ugovor o razmjeni na razini portfelja, a kriterij segmentacije 2 je jedan subjekt kako je definirano u odjeljku 6. tablici 6.1 Priloga III.	********** „STIX” – dionički indeks „DIVI” – indeks dividendi „VOLI” – indeks volatilnosti „OTHR” – drugo
		********** ispunjava se kad je identifikator MiFIR izvedenica, razred imovine odnosnog instrumenta vlasnički vrijednosni papir, podrazred imovine ugovor o razmjeni ili ugovor o razmjeni na razini portfelja, a kriterij segmentacije 2 je košarica kako je definirano u odjeljku 6. tablici 6.1 Priloga III.	********** „BSKT” – košarica
28	Parametar	Ispunjava se kad je identifikator MiFIR izvedenica, razred imovine odnosnog instrumenta jest vlasnički vrijednosni papir, a podrazred imovine jedno od sljedećeg: ugovori o razmjeni, ugovori o razmjeni na razini portfelja	„PRBP” – parametar price return basic performance „PRDV” – parametar return dividend „PRVA” – parametar return variance „PRVO” – parametar return volatility

Ugovori za razlike (CFD)

Rubrike se ispunjavaju samo kad je riječ o ugovoru za razlike ili ugovoru o okladama na raspone.

29	Vrsta odnosnog instrumenta	Ispunjava se kad je identifikator MiFIR izvedenica i kad je riječ o ugovoru za razlike ili ugovoru o okladama na raspone.	„CURR” – valuta „EQUI” – vlasnički vrijednosni papir „BOND” – obveznice „FTEQ” – budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na vlasnički vrijednosni papir „OPEQ” – opcije na vlasnički vrijednosni papir „COMM” – roba „EMAL” – emisijske jedinice „OTHR” – drugo

▼M3

30	Valuta zamišljene vrijednosti 1	Valuta 1 odnosnog valutnog para. Rubrika se primjenjuje kad je valuta odnosni instrument.	{CURRENCYCODE_3}
31	Valuta zamišljene vrijednosti 2	Valuta 2 odnosnog valutnog para. Rubrika se primjenjuje kad je valuta odnosni instrument.	{CURRENCYCODE_3}

Kreditne izvedenice

Rubrike u ovom odjeljku ispunjavaju se samo za kreditne jedinice kako je definirano u odjeljku 9. tablici 9.1 Priloga III.

32	Oznaka ISIN odnosnog ugovora o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza	Za kreditne izvedenice na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza navodi se oznaka ISIN odnosnog ugovora o razmjeni.	{ISIN}
33	Oznaka odnosnog indeksa	U rubrici se za izvedenice na osnovi indeksa CDS-a navodi oznaka ISIN za indeks.	{ISIN}
34	Naziv odnosnog indeksa	U rubrici se za izvedenice na osnovi indeksa CDS-a navodi standardizirani naziv indeksa.	{ALPHANUM-25}
35	Serije	Broj serije sastava indeksa ako je primjenjivo. U rubrici se za indeks CDS-a ili izvedenicu koja se temelji na indeksu CDS-a navodi serija tog indeksa CDS-a.	{DECIMAL-18/17}
36	Verzija	Nova verzija serije izdaje se u slučaju neuspjeha jedne sastavnice kad se indeks mora ponovno ponderirati kako bi se u obzir uzeo novi broj ukupnog broja sastavnica indeksa. U rubrici se za indeks CDS-a ili izvedenicu koja se temelji na indeksu CDS-a navodi verzija tog indeksa CDS-a.	{DECIMAL-18/17}
37	Mjeseci revizije	Svi mjeseci u kojima se za određenu godinu očekuje revizija koju je predvidio pružatelj indeksa. Rubrika se ponavlja za svaki mjesec revizije. Rubrika se ispunjava za indeks CDS-a ili izvedenicu koja se temelji na indeksu CDS-a.	01, 02, 03, 04, 05, 06, 07, 08, 09, 10, 11, 12
38	Sljedeći datum revizije	U rubrici se za indeks CDS-a ili izvedenicu koja se temelji na indeksu CDS-a navodi sljedeći datum revizije tog indeksa kako je to predvidio pružatelj indeksa.	{DATEFORMAT}
39	Državni ili javni izdavatelj	Rubrika se ispunjava kad je državni izdavatelj referentni subjekt CDS-a jednog subjekta ili izvedenice koja se temelji na CDS-u jednog subjekta kako je definirano u odjeljku 9. tablici 9.1 Priloga III.	„TRUE” – referentni subjekt je državni ili javni izdavatelj „FALSE” – referentni subjekt nije državni ili javni izdavatelj

▼M3

40	Referentna obveza	U rubrici se za izvedenicu koja se temelji na ugovoru o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza jednog subjekta navodi oznaka ISIN te referentne osnove.	{ISIN}
41	Referentni subjekt	U rubrici se navodi referentni subjekt za CDS jednog subjekta ili izvedenicu koja se temelji na CDS-u jednog subjekta.	{COUNTRYCODE_2} ili Dvoslovna oznaka države u skladu s normom ISO 3166-2 nakon koje slijedi crtica „–” i do 3 alfanumerička znaka podjele države ili {LEI}
42	Valuta zamišljene vrijednosti	Valuta u kojoj je zamišljena vrijednost denominirana.	{CURRENCYCODE_3}

Izvedenice na emisijske jedinice

Rubrike u ovom odjeljku ispunjavaju se samo za izvedenice na emisijske jedinice kako je definirano u odjeljku 13. tablici 13.1 Priloga III.

43	Podvrsta izvedenica emisijskih jedinica	Rubrika se ispunjava kad je varijabla 3 „identifikator MiFIR” „DERV” – izvedenica i kad je varijabla 4 „razred imovine odnosnog instrumenta” „EMAL” – emisijska jedinica	„CERE” – CER „ERUE” – ERU „EUAE” – EUA „EUAA” – EUAA „OTHR” – drugo

▼M3

PRILOG V.

Kvantitativni podaci koji se dostavljaju za izračune za potrebe transparentnosti

Tablica 1.

Tablica s oznakama za tablicu 2

Simbol	Vrsta podataka	Definicija
{ALPHANUM-n}	Do n alfanumeričkih znakova	Rubrika za slobodan unos teksta.
{ISIN}	12 alfanumerička znaka	Oznaka ISIN, kako je definirano u normi ISO 6166
{MIC}	4 alfanumerička znaka	Identifikacijska oznaka tržišta, kako je definirano u normi ISO 10383
{DATEFORMAT}	Format datuma u skladu s normom ISO 8601	Datumi se navode u sljedećem formatu: GGGG-MM-DD.
{DECIMAL-n/m}	Decimalni broj od ukupno najviše n znamenki od kojih najviše m znamenki može biti dio decimale	Numeričko polje za pozitivne i negativne vrijednosti. Decimalni razdjelnik je „.” (točka); negativni znakovi imaju predznak „–” (minus); vrijednosti se zaokružuju na višu, a ne smanjuju na nižu vrijednost.
{INTEGER-n}	Cijeli broj od najviše n znamenki	Numeričko polje za pozitivne i negativne vrijednosti cijelih brojeva.

Tablica 2.

Pojedinosti o podacima koje se dostavljaju radi utvrđivanja likvidnog tržišta, pragova za LIS i SSTI za nevlasničke financijske instrumente

Br.	Rubrika	Pojedinosti koje se dostavljaju	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format i standardi izvješćivanja
1	Identifikacijska oznaka instrumenta	Oznaka za identifikaciju financijskog instrumenta	Uređeno tržište (RM) Multilateralna trgovinska platforma (MTP) Organizirana trgovinska platforma (OTP) Ovlašteni sustav objavljivanja (APA) Pružatelj konsolidiranih podataka o trgovanju (CTP)	{ISIN}
2	Datum izvršenja	Datum izvršenja transakcija	RM, MTP, OTP, APA, CTP	{DATEFORMAT}

▼M3

Br.	Rubrika	Pojedinosti koje se dostavljaju	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format i standardi izvješćivanja
3	Mjesto izvršenja	MIC segmenta za mjesto trgovanja ili sistematski internalizator u EU-u ako je dostupan, u protivnom operativni MIC. MIC segmenta za sistematski internalizator ako je dostupan, u protivnom operativni MIC. MIC oznaka „XOFF” za transakcije OTC izvedenicama. APA-e za određeni ISIN i datum izvršenja u jednom unosu iskazuju svo trgovanje OTC izvedenicama za taj instrument (ISIN, XOFF, datum izvršenja).	RM, MTP, OTP, APA, CTP	{MIC} mjesta trgovanja ili sistemskog internalizatora ili „XOFF”
4	Oznaka suspendiranog instrumenta	Navodi se je li instrument na datum izvršenja na određenom mjestu trgovanja bio suspendiran iz trgovanja cijeli dan. Zato se u rubrici 5 iskazuje vrijednost nula.	RM, MTP, OTP	„TRUE” – ako je instrument bio suspendiran iz trgovanja cijeli dan ili „FALSE” – ako instrument nije bio suspendiran iz trgovanja cijeli dan
5	Ukupan broj transakcija	Ukupan broj transakcija izvršenih na datum izvršenja. Ne uključuju se transakcije koje su bile poništene. Transakcije za koje je odobreno odgođeno objavljivanje ubrajaju se u ukupne iznose koje subjekti dostave na temelju datuma izvršenja. U svim slučajevima se u rubrici iskazuje vrijednost jednaka ili veća od nula. U rubrici se za instrumente koji su suspendirani iz trgovanja cijeli dan iskazuje nula.	RM, MTP, OTP, APA, CTP	{INTEGER-18}
6	Ukupni volumen	Ukupni volumen izvršen na datum izvršenja. Volumen se mjeri u skladu s tablicom 4 iz Priloga II. ovoj Uredbi. Monetarni iznosi se iskazuju u eurima. Ne uključuju se transakcije koje su bile poništene. Transakcije za koje je odobreno odgođeno objavljivanje ubrajaju se u ukupne iznose koje subjekti dostave na temelju datuma izvršenja.	RM, MTP, OTP, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

▼M3

Br.	Rubrika	Pojedinosti koje se dostavljaju	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format i standardi izvješćivanja
7	Raspon skupine „veličina transakcije”	Ova se rubrika ispunjava vrijednostima iz tablica 3 i 4 ovog Priloga. Raspon skupine „veličina transakcije” kako je definirano: u tablici 4 ovog Priloga za emisijske jedinice i izvedenice koje se na njima temelje; u tablici 3 ovog Priloga za druge instrumente. Podaci za ovu rubriku i rubrike 8 i 9 ne iskazuju se za instrumente koji su suspendirani iz trgovanja cijeni dan.	RM, MTP, OTP, APA, CTP	{ALPHANUM -140}
8	Ukupan broj transakcija izvršenih u toj skupini	Ukupan broj transakcija izvršenih na datum izvršenja koje veličinom pripadaju u taj raspon skupine. Ne uključuju se transakcije koje su bile poništene. Transakcije za koje je odobreno odgođeno objavljivanje ubrajaju se u ukupne iznose koje subjekti dostave na temelju datuma izvršenja.	RM, MTP, OTP, APA, CTP	{INTEGER-18}
9	Ukupan volumen trgovanja za tu skupinu	Ukupan volumen trgovanja koji predstavljaju sve transakcije izvršene na izvještajni datum koje veličinom pripadaju u taj raspon skupine. Volumen se mjeri u skladu s tablicom 4 iz Priloga II. ovoj Uredbi. Monetarni iznosi se iskazuju u eurima. Ne uključuju se transakcije koje su bile poništene. Transakcije za koje je odobreno odgođeno objavljivanje ubrajaju se u ukupne iznose koje subjekti dostave na temelju datuma izvršenja.	RM, MTP, OTP, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

▼M3

Tablica 3.

Skupine po veličini transakcija za obveznice, strukturirane financijske proizvode, sekuritizirane, kamatne, vlasničke, robne, valutne i kreditne izvedenice, C10 izvedenice i ugovore za razliku (CFD)

Područje primjene	Skupina po veličini transakcija	Definicija
Transakcije veličine od 0 do 1,000,000 (isključeno)	]0–100,000[	Transakcije veličine manje od 100,000 EUR
	[100,000–100,000]	Transakcije veličine 100,000 EUR
	]100,000–200,000[	Transakcije veličine od 100,000 EUR do 200,000 EUR
	[200,000–300,000[	Transakcije veličine 200,000 EUR ili više do 300,000 EUR
	[300,000–400,000[	Transakcije veličine od 300,000 EUR do 400,000 EUR
	[Y–Y + 100,000[	Transakcije veličine od EUR Y ili više do EUR Y + 100,000 EUR (korak 100,000 EUR)
	[900,000–1,000,000[	Transakcije veličine od 900,000 EUR do 1,000,000 EUR
Transakcije veličine od 1,000,000 (uključeno) do 10,000,000 (isključeno)	[1,000,000–1,500,000[	Transakcije veličine od 1,000,000 EUR do 1,500,000 EUR
	[1,500,000–2,000,000[	Transakcije veličine od 1,500,000 EUR do 2,000,000 EUR
	[Z–Z + 500,000[	Transakcije veličine od EUR Z ili više do EUR Z + 500,000 EUR (korak 500,000 EUR)
	[9,500,000–10,000,000[	Transakcije veličine od 9,500,000 EUR do 10,000,000 EUR
Transakcije veličine od 10,000,000 (uključeno) do 100,000,000 (isključeno)	[10,000,000–15,000,000[	Transakcije veličine od 10,000,000 EUR do 15,000,000 EUR
	[15,000,000–20,000,000[	Transakcije veličine od 15,000,000 EUR do 20,000,000 EUR
	[W–W + 5,000,000[	Transakcije veličine od EUR W ili više do EUR Z + 5,000,000 EUR (korak 5,000,000 EUR)
	[95,000,000–100,000,000[	Transakcije veličine od 95,000,000 EUR do 100,000,000 EUR
Transakcije veličine 100,000,000 ili više	[100,000,000–125,000,000[	Transakcije veličine od 100,000,000 EUR do 125,000,000 EUR
	[125,000,000–150,000,000[	Transakcije veličine od 125,000,000 EUR do 150,000,000 EUR
	[X–X + 25,000,000[	Transakcije veličine od EUR X ili više do EUR X + 25,000,000 EUR (korak 25,000,000 EUR)
…	…	…

▼M3

Tablica 4.

Rasponi skupine po veličini transakcije za emisijske jedinice i izvedenice koje se temelje na emisijskim jedinicama

Područje primjene	Skupina po veličini transakcija	Definicija
Transakcije veličine od 0 do 1,000,000 (isključeno)	]0–100,000[	Transakcije veličine manje od 100,000 tona ekvivalenta ugljičnog dioksida (tCO_2e)
	[100,000–100,000]	Transakcije veličine 100,000 tCO_2e
	]100,000–200,000[	Transakcije veličine od 100,000 tCO_2e do 200,000 tCO_2e
	[200,000–300,000[	Transakcije veličine od 200,000 tCO_2e do 300,000 tCO_2e
	[300,000–400,000[	Transakcije veličine od 300,000 tCO_2e do 400,000 tCO_2e
	[Y–Y + 100,000[	Transakcije veličine Y tCO_2e ili više do Y tCO_2e + 100,000 (korak 100,000 tCO_2e)
	[900,000–1,000,000[	Transakcije veličine od 900,000 tCO_2e do 1,000,000 tCO_2e
Transakcije veličine od 1,000,000 (uključeno) do 10,000,000 (isključeno)	[1,000,000–1,500,000[	Transakcije veličine od 1,000,000 tCO_2e do 1,500,000 tCO_2e
	[1,500,000–2,000,000[	Transakcije veličine od 1,500,000 tCO_2e do 2,000,000 tCO_2e
	[Z–Z + 500,000[	Transakcije veličine Z tCO_2e ili više do Z tCO_2e + 500,000 (korak 500,000 tCO_2e)
	[9,500,000–10,000,000[	Transakcije veličine od 9,500,000 tCO_2e do 10,000,000 tCO_2e
Transakcije veličine od 10,000,000 (uključeno) do 100,000,000 (isključeno)	[10,000,000–15,000,000[	Transakcije veličine 10,000,000 tCO_2e ili više do 15,000,000 tCO_2e
	[15,000,000–20,000,000[	Transakcije veličine 15,000,000 tCO_2e ili više do 20,000,000 tCO_2e
	[W–W + 5,000,000[	Transakcije veličine W tCO_2e ili više do W tCO_2e +5,000,000 (korak 5,000,000 tCO_2e)
	[95,000,000–100,000,000[	Transakcije veličine 95,000,000 tCO_2e ili više do 100,000,000 tCO_2e
Transakcije veličine 100,000,000 ili više	[100,000,000–125,000,000[	Transakcije veličine 100,000,000 tCO_2e ili više do 125,000,000 tCO_2e
	[125,000,000–150,000,000[	Transakcije veličine 125,000,000 tCO_2e ili više do 150,000,000 tCO_2e
	[X–X + 25,000,000[	Transakcije veličine X tCO_2e ili više do X tCO_2e +25,000,000 (korak 25,000,000 tCO_2e)
…	…	…