Ez a dokumentum kizárólag tájékoztató jellegű és nem vált ki joghatást. Az EU intézményei semmiféle felelősséget nem vállalnak a tartalmáért. A jogi aktusoknak – ideértve azok bevezető hivatkozásait és preambulumbekezdéseit is – az Európai Unió Hivatalos Lapjában közzétett és az EUR-Lex portálon megtalálható változatai tekintendők hitelesnek. Az említett hivatalos szövegváltozatok közvetlenül elérhetők az ebben a dokumentumban elhelyezett linkeken keresztül

►B A BIZOTTSÁG (EU) 2017/583 FELHATALMAZÁSON ALAPULÓ RENDELETE

(2016. július 14.)

a pénzügyi eszközök piacairól szóló 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek a kötvényekkel, strukturált pénzügyi termékekkel, kibocsátási egységekkel és származtatott termékekkel kapcsolatos, kereskedési helyszínekre és befektetési vállalkozásokra vonatkozó átláthatósági követelményeket meghatározó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről

(EGT-vonatkozású szöveg)

(HL L 87., 2017.3.31., 229. o.)

Módosította:

		Hivatalos Lap		
		Szám	Oldal	Dátum
►M1	A Bizottság (EU) 2021/529 felhatalmazáson alapuló rendelete (2020. december 18.)	L 106	47	2021.3.26.
►M2	A Bizottság (EU) 2022/629 felhatalmazáson alapuló rendelete (2022. január 12.)	L 115I	1	2022.4.13.
►M3	A Bizottság (EU) 2023/945 felhatalmazáson alapuló rendelete (2023. január 17.)	L 131	17	2023.5.16.
►M4	A Bizottság (EU) 2025/1246 felhatalmazáson alapuló rendelete (2025. június 18.)	L 1246	1	2025.11.3.

Helyesbítette:

►C1 Helyesbítés, HL L 90102., 2023.11.21., 1. o. (2023/945)

▼B

A BIZOTTSÁG (EU) 2017/583 FELHATALMAZÁSON ALAPULÓ RENDELETE

(2016. július 14.)

a pénzügyi eszközök piacairól szóló 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek a kötvényekkel, strukturált pénzügyi termékekkel, kibocsátási egységekkel és származtatott termékekkel kapcsolatos, kereskedési helyszínekre és befektetési vállalkozásokra vonatkozó átláthatósági követelményeket meghatározó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről

(EGT-vonatkozású szöveg)

I. FEJEZET

FOGALOMMEGHATÁROZÁSOK

▼M4

1. cikk

Fogalommeghatározások

(A 600/2014/EU rendelet 9. cikke (5) bekezdésének f) pontja)

E rendelet alkalmazásában:

1. „központi limitáras ajánlati könyves kereskedési rendszer”: a következők bármelyike:

   a) folyamatos ajánlati könyves kereskedési rendszer, amely az ajánlati könyv és az emberi beavatkozás nélkül működtetett kereskedési algoritmus révén folyamatosan párosítja az eladási megbízásokat a vételi megbízásokkal, a legjobb rendelkezésre álló árfolyam alapján;

   b) az a) pontban említett folyamatos ajánlati könyves kereskedési rendszer és a 2. pontban meghatározott időszakos aukciós kereskedési rendszer elemeit ötvöző kereskedési rendszer;

2. „időszakos aukciós kereskedési rendszer”: olyan kereskedési rendszer, amely időszakos aukció és emberi beavatkozás nélkül működtetett kereskedési algoritmus alapján párosítja a megbízásokat.

1a. cikk

A 3., 6., 8., 9., 10., 11. és 13. cikk alkalmazási köre

(1) A 3., 6., 9., 10., 11. és 13. cikk kizárólag a származtatott termékekre alkalmazandó. A 8. cikk csak a származtatott termékekre és az ügyletcsomagokra alkalmazandó.

(2) Az e rendelet 8. és 11. cikkében szereplő, a 600/2014/EU rendelet 11. cikkére való hivatkozásokat a 600/2014/EU rendelet 2024. március 28. előtt alkalmazandó 11. cikkére való hivatkozásként kell értelmezni.

▼B

II. FEJEZET

A SZABÁLYOZOTT PIACOKRA, A MULTILATERÁLIS KERESKEDÉSI RENDSZEREKRE ÉS A SZERVEZETT KERESKEDÉSI RENDSZEREKRE VONATKOZÓ, KERESKEDÉS ELŐTTI ÁTLÁTHATÓSÁG

2. cikk

Kereskedés előtti átláthatósági kötelezettségek

(A 600/2014/EU rendelet 8. cikkének (1) és (2) bekezdése)

A kereskedési helyszínt üzemeltető piacműködtetőknek és befektetési vállalkozásoknak nyilvánosságra kell hozniuk a vételi és eladási árfolyamok sávját, valamint az ilyen árfolyamok melletti kereskedési szándék mértékét az általuk működtetett kereskedési rendszerek típusa szerint, illetve az I. mellékletben rögzített információs követelményeknek megfelelően.

3. cikk

A szokásos piaci nagyságrendet meghaladó megbízások

(A 600/2014/EU rendelet 9. cikke (1) bekezdésének a) pontja)

Egy ügylet nagyságrendje akkor haladja meg a szokásos piaci nagyságrendet, ha a megbízás nyilvántartásba vételekor vagy bármely módosítását követően ugyanakkora vagy nagyobb, mint a 13. cikkben foglalt módszertan szerint meghatározott minimális megbízási nagyságrend.

▼M4

3a. cikk

A szokásos piaci nagyságrendet meghaladó, kötvényekre, strukturált pénzügyi termékekre és kibocsátási egységekre vonatkozó megbízások

(A 600/2014/EU rendelet 9. cikke (1) bekezdésének a) pontja)

A kötvényekre, strukturált pénzügyi termékekre vagy kibocsátási egységekre vonatkozó megbízások nagyságrendje a szokásos piaci nagyságrendhez képest nagy, amennyiben a megbízás beérkezésének időpontjában vagy a megbízás bármely módosítását követően a megbízás eléri vagy meghaladja a következő küszöbértékeket:

a) a tőzsdén kereskedett áruk (ETC-k) és a tőzsdén kereskedett értékpapírok (ETN-ek) kivételével valamennyi kötvénytípus esetében a III. melléklet 2.3. táblázatában meghatározott küszöbértékek;

b) ETC-k és ETN-ek esetében a III. melléklet 2.5. táblázatában meghatározott küszöbértékek;

c) strukturált pénzügyi termékek esetében a III. melléklet 3.2. táblázatában meghatározott küszöbértékek;

d) kibocsátási egységek esetében a III. melléklet 12.2. táblázatában meghatározott küszöbértékek.

▼B

4. cikk

A közzétételükig a kereskedési helyszín megbízáskezelési rendszerében tárolt megbízások típusa és minimális nagyságrendje

(A 600/2014/EU rendelet 9. cikke (1) bekezdésének a) pontja)

(1) A közzétételéig egy kereskedési helyszín megbízáskezelési rendszerében tárolt, a kereskedés előtti átláthatósági követelmények alól mentesíthető megbízás olyan típusú megbízás, amely:

a) a kereskedési helyszín által vezetett ajánlati könyvben való közzétételre szánt, és a rendszer protokollja által előre meghatározott objektív feltételektől függ;

b) a kereskedési helyszín által vezetett ajánlati könyvbe történő felvételét megelőzően nem léphet más kereskedési szándékkal kölcsönhatásba;

c) az ajánlati könyvben történő közzététele után – az ilyen típusú megbízásokra a közzététel időpontjában alkalmazandó szabályok szerint – kölcsönhatásba lép más megbízásokkal.

(2) A közzétételükig egy kereskedési helyszín megbízáskezelési rendszerében tárolt, a kereskedés előtti átláthatósági követelmények alól mentesíthető megbízások olyan megbízások, amelyek nagyságrendje nyilvántartásukba vételükkor és bármely módosítást követően az alábbiak egyike:

a) tartalékmegbízás esetén 10 000 EUR vagy annál nagyobb értékű megbízás;

b) bármely egyéb megbízás esetén a rendszer üzemeltetője által, annak szabályai és protokolljai szerint előre meghatározott legkisebb értékesíthető mennyiséggel megegyező vagy azt meghaladó nagyságrend.

(3) A (2) bekezdés a) pontjában említett tartalékmegbízás olyan limitáras megbízásnak tekintendő, amely egy, a mennyiség egy részére vonatkozó közzétett megbízásból és egy, a fennmaradó mennyiségre vonatkozó nem megjelenített megbízásból áll, ahol a nem megjelenített mennyiség kizárólag azt követően teljesíthető, hogy az – újonnan megjelenített megbízásként – bekerül az ajánlati könyvbe.

▼M3

(4) A (2) bekezdés a) pontjának alkalmazásában a megbízáskezelési rendszerben tárolt megbízások nagyságrendjét a kereskedett szerződéseknek a II. melléklet 2. táblázatának 10. mezőjében említett névleges összegével kell mérni.

▼M4

▼B

6. cikk

Likvid piaccal nem rendelkező pénzügyi eszközök osztályai

(A 600/2014/EU rendelet 9. cikke (1) bekezdésének c) pontja)

A pénzügyi eszközt vagy pénzügyieszköz-osztályt likvid piaccal nem rendelkező pénzügyi eszköznek vagy pénzügyieszköz-osztálynak kell tekinteni, amennyiben azt – a 13. cikkben meghatározott módszertannak megfelelően – ekként határozták meg.

▼M4

6a. cikk

A kötvények, strukturált pénzügyi termékek és kibocsátási egységek likvid piaccal nem rendelkező osztályai

(A 600/2014/EU rendelet 9. cikke (1) bekezdésének c) pontja)

Annak meghatározásához, hogy egy kötvény, strukturált pénzügyi termék vagy kibocsátási egység likvid piaccal nem rendelkezőnek tekintendő-e, az illetékes hatóságok a likviditás alábbi statikus meghatározását alkalmazzák:

a) az ETC-k és az ETN-ek kivételével valamennyi kötvénytípus esetében a III. melléklet 2.2. táblázatában szereplő meghatározás;

b) ETC-k és ETN-ek esetében a III. melléklet 2.4. táblázata szerinti meghatározás;

c) strukturált pénzügyi termékek esetében a III. melléklet 3.1. táblázatában szereplő meghatározás;

d) kibocsátási egységek esetében a III. melléklet 12.1. táblázata szerinti meghatározás.

▼B

III. FEJEZET

A KERESKEDÉSI HELYSZÍNEKRE ÉS A KERESKEDÉSI HELYSZÍNEN KÍVÜL KERESKEDŐ BEFEKTETÉSI VÁLLALKOZÁSOKRA VONATKOZÓ, KERESKEDÉS UTÁNI ÁTLÁTHATÓSÁG

7. cikk

Kereskedés utáni átláthatósági kötelezettségek

(A 600/2014/EU rendelet 10. cikkének (1) bekezdése, valamint 21. cikkének (1) és (5) bekezdése)

(1) A kereskedési helyszínen kívül kereskedő befektetési vállalkozások és a kereskedési helyszínt üzemeltető piacműködtetők és befektetési vállalkozások kötelesek a II. melléklet 1. és 2. táblázatában található adatokat – az ügyletekre történő hivatkozással – nyilvánosságra hozni és a II. melléklet 3. táblázatában felsorolt jelölést alkalmazni.

▼M4

A II. melléklet 2. táblázatában meghatározott mezőneveket ugyanazon elnevezési konvenciók alkalmazásával kell közzétenni, mint amelyeket az említett táblázat mezőazonosítója meghatároz.

▼B

(2) Amennyiben egy korábban közzétett kereskedési jelentést visszavonnak, a kereskedési helyszínen kívül kereskedő befektetési vállalkozások és a kereskedési helyszínt üzemeltető piacműködtetők és befektetési vállalkozások olyan új kereskedési jelentést hoznak nyilvánosságra, amely tartalmazza az eredeti kereskedési jelentés valamennyi részletét és a II. melléklet 3. táblázatában előírt törlési jelzést.

(3) Amennyiben egy korábban közzétett kereskedési jelentést módosítanak, a kereskedési helyszínen kívül kereskedő befektetési vállalkozások és a kereskedési helyszínt üzemeltető piacműködtetők és befektetési vállalkozások a következő információkat hozzák nyilvánosságra:

a) egy új kereskedési jelentést, amely tartalmazza az eredeti kereskedési jelentés valamennyi részletét és a II. melléklet 3. táblázatában előírt törlési jelzést;

b) egy új kereskedési jelentést, amely tartalmazza az eredeti kereskedési jelentés valamennyi részletét az összes szükséges javított adattal és a II. melléklet 3. táblázatában előírt módosítási jelzést.

▼M4

(4) A kereskedés utáni információkat a valós időhöz lehető legközelebb eső időpontban kell közzétenni, de mindenképpen az adott ügylet lebonyolítását követő öt percen belül.

_____

▼B

(7) A felek minden ésszerű lépést megtesznek annak biztosítására, hogy az ügyletet egy ügyletként tegyék közzé. E célból két, azonos időben és azonos árfolyamon, egyetlen közvetítő fél által párosított kereskedés egy ügyletnek minősül.

▼M4

(8) Az ügyletcsomagra vonatkozó információknak tartalmazniuk kell a II. melléklet 3. táblázatában meghatározott ügyletcsomag-jelzést, illetve a fizikai teljesítéstől függő (EFP) ügylet jelzését. Ha az ügyletcsomagra alkalmazható a 8. cikk szerinti halasztott közzététel, valamennyi alkotóelemről információt kell közölni azt követően, hogy az ügylet halasztott közzétételi időszaka lejárt.

▼B

8. cikk

Az ügyletek halasztott közzététele

(A 600/2014/EU rendelet 11. cikkének (1) és (3) bekezdése és 21. cikkének (4) bekezdése)

(1) Amennyiben egy illetékes hatóság a 600/2014/EU rendelet 11. cikkének (1) bekezdése alapján engedélyezi az ügyletek részleteinek halasztott közzétételét, a kereskedési helyszínen kívül kereskedő befektetési vállalkozások, valamint a kereskedési helyszínt üzemeltető piacműködtetők és befektetési vállalkozások – legkésőbb az ügylet napját követő második üzleti napon, helyi idő szerint 19 óráig – valamennyi ügylet adatait nyilvánosságra hozzák, feltéve, hogy az alábbi feltételek bármelyike teljesül:

a) a 9. cikk szerinti szokásos piaci nagyságrendet meghaladó ügylet;

▼B

b) a 13. cikkben ismertetett módszertan szerinti likvid piaccal nem rendelkező pénzügyi eszközre vagy pénzügyieszköz-osztályra vonatkozóan lebonyolított ügylet;

c) az ügyletre a 2014/65/EU európai parlamenti és tanácsi irányelv [1] 4. cikke (1) bekezdésének 38. pontja értelmében vett „saját kitettség nélküli ügyletpárosítás”-tól eltérő alapon saját számlás kereskedést folytató befektetési vállalkozás és egy másik partner között kerül sor, a 10. cikkben meghatározott eszközre jellemző nagyságrendet meghaladó nagyságrendben;

d) az ügylet ügyletcsomag, amennyiben teljesíti a következő kritériumok egyikét:

i. alkotóelemei közül egy vagy több olyan pénzügyi eszközre vonatkozó ügylet, amelynek nincs likvid piaca;

ii. alkotóelemei közül egy vagy több olyan, pénzügyi eszközökre kötött ügylet, amely a 9. cikk szerinti szokásos piaci nagyságrendet meghaladó ügylet;

iii. az ügyletre a 2014/65/EU irányelv 4. cikke (1) bekezdésének 38. pontja értelmében vett „saját kitettség nélküli ügyletpárosítás”-tól eltérő alapon saját számlás kereskedést folytató befektetési vállalkozás és egy másik partner között kerül sor, és alkotóelemei közül egy vagy több olyan, pénzügyi eszközök vonatkozásában kötött ügylet, amelynek nagyságrendje meghaladja a 10. cikkben meghatározott eszközre jellemző nagyságrendet.

(2) Amikor az (1) bekezdésben meghatározott halasztás lejár, az ügylet valamennyi adatát nyilvánosságra kell hozni kivéve, ha – a 11. cikknek megfelelően – a halasztást meghosszabbítják vagy a halasztás határozatlan idejű.

(3) Amennyiben két befektetési vállalkozás közötti, saját számlás vagy ügyfél nevében lebonyolított ügyletet kereskedési helyszínen kívül bonyolítanak le, úgy a halasztott közzétételről az az illetékes hatóság dönthet, amelyik az ügyletnek a – 7. cikk (5), (6) és (7) bekezdése szerint egy jóváhagyott közzétételi mechanizmuson keresztül történő – nyilvánosságra hozataláért felelős befektetési vállalkozás illetékes hatósága.

▼M4

8a. cikk

A kötvényekkel, strukturált pénzügyi termékekkel és kibocsátási egységekkel kapcsolatos ügyletek halasztott közzététele

(A 600/2014/EU rendelet 11. cikke)

(1) A kereskedési helyszínt üzemeltető piacműködtetők és befektetési vállalkozások, valamint a kereskedési helyszínen kívül kereskedő befektetési vállalkozások a kötvényekkel kapcsolatos ügyletek adatainak közzétételét – az ETC-k és az ETN-ek kivételével – az alábbiak szerint elhalaszthatják:

[1] Az Európai Parlament és a Tanács 2014/65/EU irányelve (2014. május 15.) a pénzügyi eszközök piacairól, valamint a 2002/92/EK irányelv és a 2011/61/EU irányelv módosításáról (HL L 173., 2014.6.12., 349. o.).

▼M4

a) 15 percet meg nem haladó ár- és volumenhalasztás a III. melléklet 2.6. táblázatában említett 1. kategóriába tartozó ügyletek esetében;

b) a kereskedési nap végét meg nem haladó ár- és volumenhalasztás a III. melléklet 2.6. táblázatában említett 2. kategóriába tartozó ügyletek esetében;

c) az ügylet időpontja utáni első kereskedési nap végét meg nem haladó árhalasztás és az ügylet időpontját követő egy hetet meg nem haladó volumenhalasztás a III. melléklet 2.6. táblázatában említett 3. kategóriába tartozó ügyletek esetében;

d) az ügylet időpontja utáni második kereskedési nap végét meg nem haladó árhalasztás és az ügylet időpontját követő két hetet meg nem haladó volumenhalasztás a III. melléklet 2.6. táblázatában említett 4. kategóriába tartozó ügyletek esetében;

e) az ügylet időpontját követő négy hetet meg nem haladó ár- és volumenhalasztás a III. melléklet 2.6. táblázatában említett 5. kategóriába tartozó ügyletek esetében.

(2) A kereskedési helyszínt üzemeltető piacműködtetők és befektetési vállalkozások, valamint a kereskedési helyszínen kívül kereskedő befektetési vállalkozások az ETC-kkel, az ETN-ekkel és a strukturált pénzügyi termékekkel kapcsolatos ügyletek adatainak közzétételét az alábbiak szerint elhalaszthatják:

a) bármilyen nagyságrendű ügylet esetében az ügylet időpontját követő második kereskedési nap végét meg nem haladó árhalasztás; és

b) bármilyen nagyságrendű ügylet esetében az ügylet időpontját követő két hetet meg nem haladó volumenhalasztás.

(3) A kereskedési helyszínt üzemeltető piacműködtetőknek és befektetési vállalkozásoknak, valamint a kereskedési helyszínen kívül kereskedő befektetési vállalkozásoknak minden kibocsátási egységekkel kapcsolatos ügyletet legkésőbb az ügylet időpontját követő második munkanapon helyi idő szerint 19:00 óráig közzé kell tenniük, feltéve, hogy az ügylet meghaladja a kibocsátási egységekre vonatkozóan a III. melléklet 12.2. táblázatában említett kereskedés utáni nagyságrendet.

▼B

9. cikk

A szokásos piaci nagyságrendet meghaladó ügyletek

(A 600/2014/EU rendelet 11. cikke (1) bekezdésének a) pontja)

Az ügylet akkor minősül a szokásos piaci nagyságrendet meghaladó ügyletnek, amennyiben ugyanakkora vagy nagyobb, mint a 13. cikkben foglalt módszertan szerint meghatározott minimális ügyletnagyságrend.

▼B

10. cikk

A pénzügyi eszközre jellemző nagyságrend

(A 600/2014/EU rendelet 11. cikke (1) bekezdésének c) pontja)

Az ügylet akkor minősül a pénzügyi eszközre jellemző nagyságrendet meghaladó ügyletnek, amennyiben ugyanakkora vagy nagyobb, mint a 13. cikkben foglalt módszertan szerint meghatározott minimális ügyletnagyságrend.

11. cikk

Átláthatósági követelmények az illetékes hatóságok által azok kizárólagos mérlegelési jogkörében engedélyezett halasztott közzététel esetén

(A 600/2014/EU rendelet 11. cikkének (3) bekezdése)

(1) Amikor az illetékes hatóságok a 600/2014/EU rendelet 11. cikkének (3) bekezdése szerinti halasztott közzététel engedélyezésének összefüggésében gyakorolják jogosultságaikat, az alábbiak érvényesülnek:

a) ha a 600/2014/EU rendelet 11. cikke (3) bekezdésének a) pontja alkalmazandó, az illetékes hatóságnak a 8. cikkben meghatározott halasztás teljes időszaka alatt az alábbi két információ egyikének közlését kell kérnie:

   i. a II. melléklet 1. és 2. táblázatában rögzített valamennyi ügyletadat a volumenadat kivételével;

   ii. napi összesítésben az ugyanazon a napon végrehajtott, helyi idő szerint a következő munkanapon legkésőbb 9 óráig közzéteendő legalább 5 ügylet adatai;

b) ha a 600/2014/EU rendelet 11. cikke (3) bekezdésének b) pontja alkalmazandó, az illetékes hatóság négy héttel meghosszabbított halasztási időtartamra engedélyezheti, hogy az egyes ügyletek nagyságrendjének közzétételére ne kerüljön sor;

c) az állampapíroktól eltérő nem tulajdonviszonyt megtestesítő eszközök tekintetében, és amikor a 600/2014/EU rendelet 11. cikke (3) bekezdésének c) pontja alkalmazandó, az illetékes hatóság négy héttel meghosszabbított halasztási időtartamra engedélyezheti több, egy naptári év alatt lebonyolított ügylet adatainak összesített formában történő közzétételét a következő kedden, helyi idő szerint legkésőbb 9 óráig.

▼M4

_____

▼B

(2) Az (1) bekezdés b) pontjában meghatározott halasztás időtartamának leteltekor az alábbi követelményeket kell érvényesíteni:

a) az állampapíroktól eltérő valamennyi eszköz tekintetében az egyes ügyletekre vonatkozó valamennyi adatot közzé kell tenni a következő munkanapon, helyi idő szerint legkésőbb 9 óráig.

▼M4

_____

▼B

(3) Az állampapírok kivételével valamennyi eszköz tekintetében az ügyletek valamennyi adatát külön-külön kell közzétenni, négy héttel az (1) bekezdés c) pontja szerinti összesített adatok nyilvánosságra hozatalát követően, helyi idő szerint legkésőbb 9 óráig.

▼M4

(4) Az (1) és (2) bekezdésben említett összesített napi és heti adatoknak az alábbi információkat kell tartalmazniuk a származtatott termékek vonatkozásában az érintett naptári időszak minden egyes napja vagy hete tekintetében:

a) a súlyozott átlagár;

b) a II. melléklet 4. táblázatában említett teljes kereskedési volumen;

c) az ügyletek teljes száma.

▼B

(5) Az ügyleteket ISIN-szám szerint kell összesíteni. Amennyiben az ISIN-kód nem áll rendelkezésre, a számításokat annak a pénzügyi-eszköz-osztálynak a szintjén kell elvégezni, amelyre a 13. cikkben meghatározott likviditási teszt vonatkozik.

▼M4

(6) Amennyiben az (1) bekezdés c) pontjában, valamint a (2) és (3) bekezdésben meghatározott közzétételek tervezett napja nem munkanap, a közlésre a következő munkanapon, helyi idő szerint 9:00 óra előtt kerül sor.

11a. cikk

Állampapírokra vonatkozó átláthatósági követelmények az illetékes hatóságok által azok kizárólagos mérlegelési jogkörében engedélyezett halasztott közzététel esetén

(A 600/2014/EU rendelet 11. cikkének (3) bekezdése)

(1) Több ügylet adatainak a 600/2014/EU rendelet 11. cikke (3) bekezdésének b) pontjában említett összesített formában történő közzététele azokra az ügyletekre vonatkozik, amelyeket egy naptári hét alatt hajtottak végre, és az ilyen közzétételre a következő kedden, helyi idő szerint 9:00 óra előtt kerül sor.

(2) Az (1) bekezdésben említett összesített heti adatoknak az érintett naptári időszak minden hetére vonatkozóan a következő információkat kell tartalmazniuk:

a) a súlyozott átlagár;

b) a II. melléklet 4. táblázatában említett teljes kereskedési volumen;

c) az ügyletek teljes száma.

(3) Az ügyleteket ISIN-szám szerint kell összesíteni.

(4) Amennyiben az (1) bekezdésben meghatározott közzététel tervezett napja nem munkanap, a közlésre a következő munkanapon, helyi idő szerint 9:00 óra előtt kerül sor.

▼M3

12. cikk

A kereskedés utáni átláthatóság alkalmazása bizonyos, kereskedési helyszínen kívül végrehajtott ügyletekre

(A 600/2014/EU rendelet 21. cikkének (1) bekezdése)

A 600/2014/EU rendelet 21. cikkének (1) bekezdésében meghatározott kötelezettségek nem alkalmazandók az (EU) 2017/590 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet ([1]) 2. cikkének (5) bekezdésében felsorolt ügyletekre.

▼B

IV. FEJEZET

A KERESKEDÉS ELŐTTI ÉS UTÁNI ÁTLÁTHATÓSÁGRA VONATKOZÓ KÖZÖS RENDELKEZÉSEK

13. cikk

Az átláthatósági számítások módszertana

(A 600/2014/EU rendelet 9. cikkének (1) és (2) bekezdése, 11. cikkének (1) bekezdése és 22. cikkének (1) bekezdése)

(1) Azoknak a pénzügyi eszközöknek vagy pénzügyieszköz-osztályoknak a meghatározásához, amelyeknek – a 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában – nincs likvid piacuk, az összes eszközosztály tekintetében a következő módszertant kell alkalmazni:

a) a likviditás statikus meghatározása az alábbiak tekintetében:

i. a III. melléklet 4.1. táblázatában meghatározott értékpapírosított származtatott ügyletek eszközosztálya;

ii. a származtatott részvényügyletek következő eszköz-alosztályai: a III. melléklet 6.1. táblázatában meghatározott részvényindex-opciók, határidős tőzsdei és tőzsdén kívüli részvényindex-ügyletek, részvényopciók, határidős tőzsdei és tőzsdén kívüli részvényügyletek, részvényosztalék-opciók, határidős tőzsdei és tőzsdén kívüli részvényosztalék-ügyletek, osztalékindex-opciók, határidős tőzsdei és tőzsdén kívüli osztalékindex-ügyletek, volatilitásindex-opció, határidős tőzsdei és tőzsdén kívüli volatilitásindex-ügyletek, ETF-opciók, határidős tőzsdei és tőzsdén kívüli ETF-ügyletek és egyéb származtatott ügyletek;

iii. a III. melléklet 8.1. táblázatában meghatározott származtatott devizaügyletek eszközosztálya;

▼M4

iv. a III. melléklet 5.1., 7.1., 9.1., 10.1., 11.1. és 13.1. táblázatában hivatkozott egyéb származtatott kamatügyletek, egyéb származtatott áruügyletek, egyéb származtatott hitelügyletek, egyéb „C10” típusú származtatott ügyletek, egyéb különbözeti ügyletek (CFD) és egyéb kibocsátáskereskedelmi derivatívák eszköz-alosztályai.

([1]) A Bizottság (EU) 2017/590 felhatalmazáson alapuló rendelete (2016. július 28.) a 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek az ügyletek illetékes hatóságoknak történő bejelentésére vonatkozó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről (HL L 87., 2017.3.31., 449. o.).

▼B

b) mennyiségi és adott esetben minőségi likviditási kritériumokon alapuló időszakos értékelés a következőkre vonatkozóan:

▼M4

_____

▼B

iii. a III. melléklet 5.1. táblázatában meghatározott származtatott kamatügyletek eszközosztálya, az egyéb származtatott kamatügyletek eszköz-alosztálya kivételével;

iv. a származtatott részvényügyletek következő eszköz-alosztályai: a III. melléklet 6.1. táblázatában meghatározott csereügyletek és portfólió-csereügyletek;

v. a III. melléklet 7.1. táblázatában meghatározott származtatott áruügyletek eszközosztálya, az egyéb származtatott áruügyletek eszköz-alosztálya kivételével;

vi. a származtatott hitelügyletek következő eszköz-alosztályai: a III. melléklet 9.1. táblázatában meghatározott indexhez kötött hitel-nemteljesítési csereügyletek és egytermékes hitel-nemteljesítési csereügyletek;

vii. a III. melléklet 10.1. táblázatában meghatározott „C10” típusú származtatott ügyletek eszközosztálya, az egyéb „C10” típusú származtatott ügyletek eszköz-alosztálya kivételével;

viii. a különbözeti ügyletek (CFD) következő eszköz-alosztályai: a III. melléklet 11.1. táblázatában meghatározott devizaalapú CFD-ügyletek és árualapú CFD-ügyletek;

▼M4

_____

▼B

x. a III. melléklet 13.1. táblázatában meghatározott kibocsátáskereskedelmi derivatívák eszközosztálya, az egyéb kibocsátáskereskedelmi derivatívák eszköz-alosztálya kivételével;

c) minőségi likviditási kritériumokon alapuló időszakos értékelés a következőkre vonatkozóan:

i. a származtatott hitelügyletek következő eszköz-alosztályai: a III. melléklet 9.1. táblázatában meghatározott CDS-index opciók és egy alaptermékes CDS-opciók;

ii. a különbözeti ügyletek (CFD) következő eszköz-alosztályai: a III. melléklet 11.1. táblázatában meghatározott részvényalapú CFD-ügyletek, kötvényalapú CFD-ügyletek, határidős tőzsdei vagy tőzsdén kívüli részvényügyleten alapuló CFD-ügyletek és részvényopción alapuló CFD-ügyletek.

▼M4

_____

▼B

(2) ►M4 A 3. cikkben említett, szokásos piaci nagyságrendet meghaladó megbízások meghatározására a következő módszertant kell alkalmazni: ◄

a) küszöbérték a következők tekintetében:

▼M4

_____

▼B

ii. a III. melléklet 4.2. táblázatában meghatározott értékpapírosított származtatott ügyletek eszközosztálya;

iii. a III. melléklet 6.2. és 6.3. táblázatában meghatározott származtatott részvényügyletek valamennyi eszköz-alosztálya;

iv. a III. melléklet 8.2. táblázatában meghatározott származtatott devizaügyletek valamennyi eszköz-alosztálya;

v. valamennyi olyan eszköz-alosztály, amely a III. melléklet 5.3., 7.3., 9.3., 10.3. és 11.3. táblázataiban meghatározott származtatott kamatügyletek, származtatott áruügyletek, származtatott hitelügyletek, a C10 szerinti származékos termékek és különbözeti ügyletek (CFD) tekintetében likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül;

▼M4

vi. valamennyi olyan eszköz-alosztály, amely a III. melléklet 13.3. táblázatában említett kibocsátáskereskedelmi derivatívák eszközosztálya tekintetében likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül.

_____

▼B

b) ►M4 azon kereskedési nagyságrend, amely alatt a meghatározott kereskedési percentilisnek megfelelő ügyletszázalék található, és a küszöbérték alapja közül a magasabb érték a következők vonatkozásában: ◄

▼M4

_____

▼B

ii. valamennyi olyan eszköz-alosztály, amely likvid piacot biztosít a III. melléklet 5.2., 7.2., 9.2., 10.2. és 11.2. táblázataiban meghatározott származtatott kamatügyletek, származtatott áruügyletek, származtatott hitelügyletek, a C10 szerinti származékos termékek és különbözeti ügyletek (CFD) részére;

▼M4

iii. valamennyi olyan eszköz-alosztály, amely a III. melléklet 13.2. táblázatában említett kibocsátáskereskedelmi derivatívák eszközosztálya tekintetében likvid piaccal rendelkezőnek minősül;

_____

▼B

(3) A pénzügyi eszközre jellemző nagyságrend (8. cikk (1) bekezdésének c) pontja) és a szokásos piaci nagyságrendet meghaladó ügylet (8. cikk (1) bekezdésének a) pontja) meghatározásához következő módszertant kell alkalmazni:

a) küszöbérték a következők tekintetében:

▼M4

_____

▼B

ii. a III. melléklet 4.2. táblázatában meghatározott értékpapírosított származtatott ügyletek eszközosztálya;

iii. a III. melléklet 6.2. és 6.3. táblázatában meghatározott származtatott részvényügyletek valamennyi eszköz-alosztálya;

iv. a III. melléklet 8.2. táblázatában meghatározott származtatott devizaügyletek valamennyi eszköz-alosztálya;

v. valamennyi olyan eszköz-alosztály, amely a III. melléklet 5.3., 7.3., 9.3., 10.3. és 11.3. táblázataiban meghatározott származtatott kamatügyletek, származtatott áruügyletek, származtatott hitelügyletek, a „C10” típusú származtatott ügyletek és a különbözeti ügyletek (CFD) tekintetében likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül;

▼M4

vi. valamennyi olyan eszköz-alosztály, amely a III. melléklet 13.3. táblázatában említett kibocsátáskereskedelmi derivatívák eszközosztálya tekintetében likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül;

_____

_____

▼B

c) azon kereskedési nagyságrend, amely alatt a kereskedési percentilisnek megfelelő ügyletszázalék található, azon kereskedési nagyságrend, amely alatt a volumenpercentilisnek megfelelő volumenszázalék található, és a küszöbérték alapja közül a legmagasabb érték a származtatott kamatügyletek, származtatott áruügyletek, származtatott hitelügyletek, „C10” típusú származtatott ügyletek és különbözeti ügyletek (CFD) tekintetében likvid piaccal rendelkezőnek minősülő egyes alosztályok esetében, a III. melléklet 5.2., 7.2., 9.2., 10.2. és 11.2. táblázatainak meghatározása szerint;

▼M4

d) azon kereskedési nagyságrend, amely alatt a meghatározott kereskedési percentilisnek megfelelő ügyletszázalék található, és a küszöbérték alapja közül a magasabb érték a kibocsátáskereskedelmi derivatívák III. melléklet 13.2. táblázata szerinti, likvid piaccal rendelkezőnek minősülő eszköz-alosztályai vonatkozásában.

▼B

(4) A (3) bekezdés c) pontja alkalmazásában, amikor a szokásos piaci nagyságrendet meghaladó ügylet meghatározására alkalmazott volumenpercentilisnek megfelelő kereskedési nagyságrend meghaladja a 97,5 kereskedési percentilist, a kereskedelmi volument nem kell figyelembe venni, és a 8. cikk (1) bekezdésének c) pontjában említett, a pénzügyi eszközre jellemző nagyságrend, továbbá a 8. cikk (1) bekezdésének c) pontjában említett, a szokásos piaci nagyságrendet meghaladó ügylet nagyságrendje azon ügyletnagyságrend, amely alatt a kereskedési percentilisnek megfelelő ügyletszázalék található, és a küszöbérték alapja közül a magasabb érték.

▼B

(5) Az (EU) 2017/590 és az (EU) 2017/577 felhatalmazáson alapuló rendelettel összhangban, az illetékes hatóság naponta gyűjt adatokat a kereskedési helyszínektől, az APA-któl és a CTP-ktől annak érdekében, hogy elvégezhesse a következők meghatározásához szükséges számításokat:

a) az (1) bekezdés szerinti, likvid piaccal nem rendelkező pénzügyi eszközök és pénzügyieszköz-osztályok;

▼M4

b) a szokásos piaci nagyságrendet meghaladó ügyletnagyságrend és az eszközre jellemző nagyságrend a (3) bekezdés szerint.

▼M3

Az első albekezdésben említett adatokat az V. melléklettel összhangban kell gyűjteni.

▼B

(6) A pénzügyieszköz-osztályra vonatkozó számításokat végző illetékes hatóságok együttműködnek egymással annak érdekében, hogy az Unió valamennyi tagállamában biztosítsák a számításokhoz szükséges adatösszesítést.

▼M4

(7) Az (1) bekezdés b) pontja, a (2) bekezdés b) pontja és a (3) bekezdés c) és d) pontja alkalmazásában az illetékes hatóságok a megelőző év január 1. és december 31. között az Unióban végrehajtott ügyleteket veszik figyelembe.

(8) A kereskedés nagyságrendjét a (2) bekezdés b) pontja és a (3) bekezdés c) és d) pontja alkalmazásában a II. melléklet 4. táblázatában meghatározott volumenmérték alapján kell meghatározni. Ha az ügyletnek a (2) és a (3) bekezdés alkalmazásában meghatározott nagyságrendjét monetáris értékben fejezik ki, és a pénzügyi eszköz nem EUR-ban denominált, a kereskedési nagyságrendet a pénzügyi eszköz pénznemére kell konvertálni az Európai Központi Banknak a megelőző év december 31-én érvényes, EUR-ra megállapított referencia-devizaárfolyamán.

▼B

(9) A piacműködtetők és a kereskedési helyszínt üzemeltető befektetési vállalkozások a (2) és a (3) bekezdés szerint meghatározott kereskedési nagyságrendet a kereskedési helyszín által az egyes alosztályokra és eszköz-alosztályokra előzetesen meghatározott, megfelelő számú tételekké alakíthatják. A piacműködtetők és a kereskedési helyszínt üzemeltető befektetési vállalkozások – a 17. cikkben foglaltak szerint elvégzett következő számítások eredményének alkalmazásáig – fenntarthatják ezt a kereskedési nagyságrendet.

▼M4

_____

(11) A (2) és (3) bekezdésben említett meghatározások tekintetében, amennyiben a számításokhoz figyelembe vett ügyletek száma nem éri el az ezret, a (2) bekezdés b) pontja és a (3) bekezdés c) és d) pontja nem alkalmazandó. Ezekben az esetekben ehelyett a (2) bekezdés a) pontjában és a (3) bekezdés a) pontjában meghatározott küszöbértékeket kell alkalmazni.

▼B

(12) ►M4 A kibocsátáskereskedelmi derivatívákra vonatkozó számítások kivételével a (2) bekezdés b) pontjában és a (3) bekezdés c) pontjában említett összegeket az alábbi összegekre kell felkerekíteni: ◄

a) 100 000, ha a küszöbérték 1 milliónál alacsonyabb;

b) 500 000, ha a küszöbérték eléri az 1 milliót, de kevesebb, mint 10 millió;

c) 5 millió, ha a küszöbérték eléri a 10 milliót, de kevesebb, mint 100 millió;

d) 25 millió, ha a küszöbérték eléri a 100 milliót.

(13) Az (1) bekezdés alkalmazásában az egyes eszközosztályokra a III. mellékletben előírt mennyiségi likviditási kritériumokat a III. melléklet 1. szakaszának megfelelően kell meghatározni.

▼M4

(14) A kereskedési helyszínre bevezetett vagy ott első alkalommal kereskedett azon származtatott részvényügyletek vonatkozásában, amelyek nem tartoznak egyetlen olyan alosztályba sem, amelyre vonatkozóan közzétették a pénzügyi eszköznek a 8. cikk (1) bekezdésének c) pontjában említett, jellemző nagyságrendjét és a 3. cikkben és a 8. cikk (1) bekezdésének a) pontjában említett, a szokásos piaci nagyságrendet meghaladó megbízás és ügylet nagyságrendjét, és amelyek az (1) bekezdés a) pontjának ii. alpontjában meghatározott eszköz-alosztályok egyikébe tartoznak, a pénzügyi eszközre jellemző nagyságrend és a szokásos piaci nagyságrendet meghaladó megbízás és ügylet nagyságrendje az a nagyságrend, amelyet annak az eszköz-alosztálynak a legalacsonyabb átlagos napi névleges összegsávjára (ADNA) kell alkalmazni, amelybe a származtatott részvényügyletek tartoznak.

(15) A kereskedési helyszínre bevezetett vagy ott első alkalommal kereskedett azon pénzügyi eszközöket, amelyek nem tartoznak egyetlen olyan alosztályba sem, amelyre vonatkozóan közzétették a pénzügyi eszköznek a 8. cikk (1) bekezdésének c) pontjában említett, jellemző nagyságrendjét és a 3. cikkben és a 8. cikk (1) bekezdésének a) pontjában említett, a szokásos piaci nagyságrendet meghaladó megbízás és ügylet nagyságrendjét, likvid piaccal nem rendelkező eszközöknek kell tekinteni a (17) bekezdés szerint elvégzett számítások eredményeinek alkalmazásáig. A pénzügyi eszköz 8. cikk (1) bekezdésének c) pontjában említett jellemző, alkalmazandó nagyságrendje, valamint a 3. cikkben és a 8. cikk (1) bekezdésének a) pontjában említett, a szokásos piaci nagyságrendet meghaladó megbízás és ügylet nagyságrendje megegyezik az ugyanazon eszköz-alosztályba tartozó, likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő alkategóriák nagyságrendjével.

▼B

(16) A kereskedési nap lezárulta után, de még az adott nap vége előtt a kereskedési helyszínek benyújtják az illetékes hatóságoknak az 5. bekezdésben említett számítások elvégzéséhez szükséges, a IV. mellékletben található adatokat minden olyan esetben, amikor a pénzügyi eszközt az adott kereskedési helyszínre bevezetik vagy ott első alkalommal kereskednek vele, illetve amikor a korábban szolgáltatott adatokban változás következik be.

▼M3

(17) Az illetékes hatóság valamennyi pénzügyi eszközre vagy pénzügyieszköz-osztályra vonatkozóan biztosítja az (5) bekezdésben említett számítások eredményének közzétételét a 600/2014/EU rendelet alkalmazásának kezdőnapját követő év április 30-ig, azt követően pedig minden év április 30-ig. A közzétett számítási eredményeket az adott év júniusának első hétfőjétől a következő év júniusának első hétfőjéig kell alkalmazni.

▼M4

_____

▼B

14. cikk

Azok az ügyletek, amelyekre a 600/2014/EU rendelet 1. cikkének (6) bekezdésében előírt mentesség alkalmazandó

(A 600/2014/EU rendelet 1. cikkének (6) bekezdése)

Egy ügyletet a Központi Bankok Európai Rendszere (KBER) egyik tagja által a monetáris, a devizaműveletekre és a pénzügyi stabilitásra vonatkozó politika megvalósítása érdekében lebonyolított ügyletnek kell tekinteni, amennyiben az ügylet a következő követelmények bármelyikét teljesíti:

a) az ügylet monetáris politikai célú ügylet, ideértve a Központi Bankok Európai Rendszere és az Európai Központi Bank – az Európai Unióról szóló szerződés mellékletét képező – alapokmányának 18. és 20. cikkével összhangban, valamint a pénznemükként nem az EUR-t használó tagállamok KBER-tagjaira érvényes, ennek megfelelő nemzeti jogszabályi rendelkezésekben foglaltaknak megfelelően végrehajtott műveletet is;

b) az ügylet devizaművelet, ideértve a tagállamok hivatalos devizatartalékainak tartása és kezelése érdekében lebonyolított ügyleteket vagy valamely KBER-tag harmadik országbeli központi bankok részére nyújtott tartalékkezelési szolgáltatásait, amelyek a 600/2014/EU rendelet 1. cikke (9) bekezdésének értelmében mentességet élveznek;

c) a pénzügyi stabilitási politika keretében végrehajtott műveletek.

15. cikk

Azok az ügyletek, amelyekre a 600/2014/EU rendelet 1. cikkének (6) bekezdésében előírt mentesség nem alkalmazandó

(A 600/2014/EU rendelet 1. cikkének (7) bekezdése)

A 600/2014/EU rendelet 1. cikkének (6) bekezdése nem alkalmazandó a következő ügylettípusokra, amelyeket valamely KBER-tag olyan befektetési művelet céljából bonyolít le, amely nem kapcsolódik a 14. cikkben említett feladatok KBER-tag általi elvégzéséhez:

a) saját alapjainak kezelése érdekében lebonyolított ügyletek;

▼B

b) igazgatási célú vagy a KBER-tagok személyzete részére lebonyolított műveletek, ideértve a nemzeti központi bankok munkavállalói nyugdíjalap-kezelői minőségükben lebonyolított kereskedéseit;

c) a KBER-tag befektetési portfóliójához kapcsolódó, a nemzeti jogszabályok szerinti kötelezettségek értelmében végrehajtott ügyletek.

▼M4

16. cikk

Az átláthatósági kötelezettségek ideiglenes felfüggesztése

(A 600/2014/EU rendelet 9. cikkének (4) bekezdése)

(1) Azokra a pénzügyi eszközökre vonatkozóan, amelyek a kötvények, strukturált pénzügyi termékek és kibocsátási egységek tekintetében a 6a. cikkben, a származtatott termékek esetében pedig a 13. cikkben foglalt módszertan alapján likvid piaccal rendelkeznek, az illetékes hatóságok ideiglenesen felfüggeszthetik a 600/2014/EU rendelet 8., 8a. és 10. cikkében meghatározott kötelezettségeket, ha egy bizonyos kötvényosztálynak, illetve a strukturált pénzügyi termékek, kibocsátási egységek vagy származtatott termékek egy bizonyos osztályának a II. melléklet 4. táblázata szerint az előző 30 naptári napra számított teljes mennyisége nem éri el a 30 naptári napot megelőző 12 teljes naptári hónapra számított átlagos havi mennyiség 40 %-át.

(2) Azokra a pénzügyi eszközökre vonatkozóan, amelyek a kötvények, strukturált pénzügyi termékek és kibocsátási egységek tekintetében a 6a. cikkben, a származtatott termékek esetében pedig a 13. cikkben foglalt módszertan alapján nem rendelkeznek likvid piaccal, az illetékes hatóságok ideiglenesen felfüggeszthetik a 600/2014/EU rendelet 8., 8a. és 10. cikkében meghatározott kötelezettségeket, ha egy bizonyos kötvényosztálynak, illetve a strukturált pénzügyi termékek, kibocsátási egységek vagy származtatott termékek egy bizonyos osztályának a II. melléklet 4. táblázata szerint az előző 30 naptári napra számított teljes mennyisége nem éri el a 30 naptári napot megelőző 12 teljes naptári hónapra számított átlagos havi mennyiség 20 %-át.

(3) Az illetékes hatóságoknak az adott kötvényosztály, illetve a strukturált pénzügyi termékek, kibocsátási egységek vagy származtatott termékek adott osztálya tekintetében az Unió valamennyi kereskedési helyszínén lebonyolított ügyleteket figyelembe kell venniük az (1) és a (2) bekezdésben említett számítások során. Az illetékes hatóságoknak ezeket a számításokat azon pénzügyieszköz-osztály szintjén kell elvégezniük, amelyre a kötvényekre, strukturált pénzügyi termékekre és kibocsátási egységekre vonatkozóan a 6a. cikkben, a származtatott termékekre vonatkozóan pedig a 13. cikkben meghatározott likviditási teszt alkalmazandó.

(4) Az átláthatósági kötelezettségek felfüggesztése előtt az illetékes hatóságoknak meg kell győződniük arról, hogy a likviditás valamennyi kereskedési helyszínen tapasztalt jelentős csökkenése nem a pénzügyi eszközök adott osztályának a likviditásra gyakorolt szezonális hatása.

▼B

19. cikk

Hatálybalépés és alkalmazás

Ez a rendelet az Európai Unió Hivatalos Lapjában való kihirdetését követő huszadik napon lép hatályba.

Ezt a rendeletet 2018. január 3-tól kell alkalmazni. A 18. cikk azonban már e rendelet hatálybalépésének napjától alkalmazandó.

Ez a rendelet teljes egészében kötelező és közvetlenül alkalmazandó valamennyi tagállamban.

▼**M4**

I. MELLÉKLET

Rendszertípusok és a 2. cikkel összhangban közzéteendő kapcsolódó információk

Rendszertípus	Közzéteendő információk
Folyamatos ajánlati könyves kereskedési rendszer	Minden egyes pénzügyi eszköz esetében a megbízások teljes száma és azok volumene az egyes árfolyamszinteken, legalább az öt legjobb vételi és eladási árfolyamszint esetében.
Időszakos aukciós kereskedési rendszer	Minden egyes pénzügyi eszköz esetében az árfolyam, amelyen az aukciós kereskedési rendszer a leginkább megfelelne a kereskedési algoritmusnak, valamint az a mennyiség, amelyet az adott rendszer résztvevői ezen az árfolyamon potenciálisan végrehajthatnának.

▼B

II. MELLÉKLET

Az ügyletek nyilvánosságra hozandó adatai

1. táblázat

A 2. táblázatban használt jelölések magyarázata

JELÖLÉS	ADATTÍPUS	MEGHATÁROZÁS
{ALPHANUM-n}	Legfeljebb n számú alfanumerikus karakter	Szövegmező
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerikus karakter	Az ISO 4217 szabvány szerinti pénznemkódoknak megfelelő hárombetűs pénznemkód.
{DATE_TIME_FORMAT}	Az ISO 8601 szabvány szerinti dátum- és időformátum	Dátum és idő a következő formátumban: YYYY-MM-DDThh:mm:ss.dddddZ. ahol: — „YYYY” az év; — „MM” a hónap; — „DD” a nap; — „T” – azt jelenti, hogy a T betűt kell használni — „hh” az óra; — „mm” a perc; — „ss.dddddd” a másodperc és annak törtrésze; — Z az UTC-időzóna. A dátumokat és időpontokat UTC-időben kell megadni.
{DECIMAL-n/m}	Összesen legfeljebb n számjegyből álló tizedes tört, amely legfeljebb m számú tizedesjegyet tartalmazhat	Numerikus mező pozitív és negatív értékek megadásához — tizedesjel:„,” (vessző); — a negatív számok előtt „–” (mínusz) jelet kell használni; Az értékeket – ahol szükséges – kerekíteni kell, azaz nem csonkolhatók.
{ISIN}	12 alfanumerikus karakter	Az ISO 6166 szabványnak megfelelő ISIN-kód
{MIC}	4 alfanumerikus karakter	Az ISO 10383 szabványnak megfelelő piacazonosító

▼M4

2. táblázat

A kereskedés utáni átláthatóság érdekében közzéteendő adatok jegyzéke

A közzétett mezőneveknek (oszlopcímeknek) meg kell egyezniük a 2. táblázatban megadott mezőazonosítókkal

#	Mezőazonosító	Pénzügyi eszközök	Ismertetés és közzéteendő adatok	Végrehajtási/közzétevő helyszín típusa	Az adatszolgáltatás 1. táblázat szerinti formátuma
1.	Kereskedés dátuma és időpontja	Az összes pénzügyi eszköz esetében	Az ügylet végrehajtásának dátuma és időpontja. A kereskedési helyszínen végrehajtott ügyletek esetében a pontosságra vonatkozó követelményeket az (EU) 2025/1155 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet ([1]) 12. cikke határozza meg. A kereskedési helyszínen kívül végrehajtott ügyletek esetében azt a dátumot és időpontot kell megadni, amikor a felek megállapodtak a következő adatmezők tartalmáról: mennyiség, árfolyam, pénznem (az (EU) 2017/590 felhatalmazáson alapuló rendelet I. melléklete 2. táblázatának 31., 34. és 44. mezőjében meghatározottaknak megfelelően), eszközazonosító kód, eszközkategória, valamint adott esetben az alapeszköz kódja. A kereskedési helyszínen kívül végrehajtott ügyletek esetében az időpontot legalább egy másodperc pontossággal kell megadni. Ha az ügylet a végrehajtó vállalkozás által harmadik fél számára egy ügyfél nevében továbbított megbízás eredményeképpen jön létre, és amennyiben nem teljesülnek az (EU) 2017/590 felhatalmazáson alapuló rendelet 4. cikkében a továbbítás tekintetében előírt feltételek, a megbízás továbbításának időpontja helyett az ügylet dátumát és időpontját kell megadni.	Szabályozott piac (RM) Multilaterális kereskedési rendszer (MTF) Szervezett kereskedési rendszer (OTF) Jóváhagyott közzétételi mechanizmus (APA)	{DATE_TIME_ FORMAT}
2.	Eszközazonosító kód	Az összes pénzügyi eszköz esetében	A pénzügyi eszköz azonosításához használt kód	RM, MTF, OTF, APA	{ISIN}

▼M4

#	Mezőazonosító	Pénzügyi eszközök	Ismertetés és közzéteendő adatok	Végrehajtási/közzétevő helyszín típusa	Az adatszolgáltatás 1. táblázat szerinti formátuma
3.	Árfolyam	Az összes pénzügyi eszköz esetében	Az ügylet kereskedett árfolyama, adott esetben a jutalék és a felhalmozott kamat nélkül. A kereskedett árfolyamról a szokásos piaci konvencióknak megfelelően kell adatot szolgáltatni. Az e mezőben feltüntetett értéknek összhangban kell lennie az „Árjelzés” mezőben megadott értékkel. Ha az árfolyam jelenleg nem áll rendelkezésre, hanem függőben van („PNDG”) vagy nem alkalmazható („NOAP”), akkor a mezőt nem kell kitölteni.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/13}, ha az árfolyam megadása monetáris értékkel történik {DECIMAL-11/10}, ha az árfolyam megadása százalékkal vagy hozammal történik {DECIMAL-18/17}, ha az árfolyam megadása bázispontban történik
4.	Hiányzó árfolyam	Az összes pénzügyi eszköz esetében	Ha az ár jelenleg nem áll rendelkezésre, hanem függőben van, akkor a „PNDG” értéket kell megadni. Amennyiben nem alkalmazható árfolyam, a „NOAP” jelölést kell megadni.	RM, MTF, OTF, APA	„PNDG”, ha az árfolyam nem áll rendelkezésre „NOAP”, ha az árfolyam nem alkalmazható
5.	Az árfolyam pénzneme	Az összes pénzügyi eszköz esetében	Az a pénznem, amelyben az árfolyamot kifejezik (akkor alkalmazandó, ha az árfolyamot monetáris értékkel adják meg).	RM, MTF, OTF, APA	{CURRENCY CODE_3}
6.	Árjelzés	Az összes pénzügyi eszköz esetében	Azt jelöli, hogy az árat monetáris értékkel, százalékos arányként, bázispontokban vagy hozammal fejezik-e ki. Az árjelzésről a szokásos piaci konvencióknak megfelelően kell adatot szolgáltatni. Hitel-nemteljesítési csereügyletek esetében „BAPO”-t kell feltüntetni. A kötvények (az ETN-ek és az ETC-k kivételével) esetében a mezőbe a névleges összeg százalékát jelölő „PERC” írandó. Ha a szokásos piaci konvenció nem a százalékban kifejezett ár, akkor e mezőbe a szokásos piaci konvenciónak megfelelően „YIEL”, „BAPO” vagy „MONE” írandó. Az e mezőben feltüntetett értéknek összhangban kell lennie az „Árfolyam” mezőben megadott értékkel. Ha az árfolyam megadása monetáris értékkel történik, azt a fő pénznemegységben kell megadni.	RM, MTF, OTF, APA	„MONE” – monetáris érték „PERC” – százalék „YIEL” – hozam „BAPO” – bázispont

▼M4

#	Mezőazonosító	Pénzügyi eszközök	Ismertetés és közzéteendő adatok	Végrehajtási/közzétevő helyszín típusa	Az adatszolgáltatás 1. táblázat szerinti formátuma
			Ha az árfolyam jelenleg nem áll rendelkezésre, hanem függőben van („PNDG”) vagy nem alkalmazható („NOAP”), ezt a mezőt nem kell kitölteni.		
7.	Mennyiség	Minden pénzügyi eszköz esetében, kivéve az e rendelet 11. cikke (1) bekezdésének a) és b) pontjában meghatározott eseteket.	Egységekben kereskedett pénzügyi eszközök esetében a pénzügyi eszköz egységeinek száma. Ellenkező esetben üresen kell hagyni.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL- 18/17}
8.	A mértékegységben kifejezett mennyiség	Megjelölt mértékegységeket használó származtatott áruügyletek, „C10” típusú származtatott ügyletek, kibocsátáskereskedelmi derivatívák és kibocsátási egységek esetében, kivéve az e rendelet 11. cikke (1) bekezdésének a) és b) pontjában meghatározott eseteket.	A kereskedett áruk vagy kibocsátási egységek mértékegységben kifejezett egyenértékű összege.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL- 18/17}
9.	A mennyiség mértékegysége	Megjelölt mértékegységeket használó származtatott áruügyletek, „C10” típusú származtatott ügyletek, kibocsátáskereskedelmi derivatívák és kibocsátási egységek esetében, kivéve az e rendelet 11. cikke (1) bekezdésének a) és b) pontjában meghatározott eseteket.	A mennyiség megadása során alkalmazott mértékegység meghatározása.	RM, MTF, OTF, APA	„TOCD” – tonna szén-dioxid-egyenérték a kibocsátási egységekkel kapcsolatos ügyletek esetében „TONE” – metrikus tonna „MWHO” – megawattóra „MBTU” – egymillió brit termikus energiaegység „THMS” – therm „DAYS” – nap vagy {ALPHANUM-4} máskülönben

▼M4

#	Mezőazonosító	Pénzügyi eszközök	Ismertetés és közzéteendő adatok	Végrehajtási/közzétevő helyszín típusa	Az adatszolgáltatás 1. táblázat szerinti formátuma
10.	Névleges összeg	Minden pénzügyi eszköz esetében, kivéve az e rendelet 11. cikke (1) bekezdésének a) és b) pontjában meghatározott eseteket.	Ezt a mezőt a következőképpen kell kitölteni: i) (az ETC-k és az ETN-ek kivételével) kötvények esetében a névértéket kell megadni, amely a befektetőnek visszaváltáskor visszafizetett összeg; ii) az ETC-k és ETN-ek, valamint az értékpapírosított származtatott termékek esetében a vevők és az eladók között kicserélt eszközök számának és az adott ügyletben kicserélt eszköz árfolyamának szorzatát kell megadni. Ennek megfelelően az árfolyam mező értékét meg kell szorozni a mennyiség mező értékével; iii) strukturált pénzügyi termékek (SFP-k) esetében az egységenkénti névérték és az eszközök ügyletkori számának szorzatát kell megadni; iv) hitel-nemteljesítési csereügyletek esetében azt a névleges összeget kell megadni, amelyre vonatkozóan a védelmet megszerzik vagy rendelkezésre bocsátják; v) opciók, csereügyletre szóló opciók, a iv. pontban említettektől eltérő csereügyletek, tőzsdei és tőzsdén kívüli határidős ügyletek esetében a szerződés névleges összegét kell megadni; vi) a kibocsátási egységek esetében a szerződésben meghatározott, az ügylet időpontjában érvényes árfolyamnak a vonatkozó mennyiségre adódó összegét kell feltüntetni. Ennek megfelelően az árfolyam mező értékét meg kell szorozni a mértékegységben kifejezett mennyiség mező értékével; vii) különbözetre fogadás (spread bet) esetében az ügylet időpontjában az alapul szolgáló pénzügyi eszköz egységnyi áralakulására eső kockáztatott monetáris értéket kell megadni;	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/5}

▼M4

#	Mezőazonosító	Pénzügyi eszközök	Ismertetés és közzéteendő adatok	Végrehajtási/közzétevő helyszín típusa	Az adatszolgáltatás 1. táblázat szerinti formátuma
			viii) a különbözeti ügyletek (CFD) esetében a vevők és az eladók között kicserélt eszközök számának és az adott ügyletben kicserélt eszköz árfolyamának szorzatát kell megadni. Ennek megfelelően az árfolyam mező értékét meg kell szorozni a mennyiség mező értékével.		
11.	Névleges pénznem	Minden pénzügyi eszköz esetében, kivéve az e rendelet 11. cikke (1) bekezdésének a) és b) pontjában meghatározott eseteket.	Az a pénznem, amelyben a névleges érték denominált. Devizaalapú származtatott ügylet, többdevizás csereügylet vagy olyan csereügyletre szóló opció esetében, ahol az alapul szolgáló csereügylet többdevizás vagy devizaalapú CFD-ügylet vagy különbözetre fogadás, ez lesz az 1. oldal névleges pénzneme.	RM, MTF, OTF, APA	{CURRENCY CODE_3}
12.	[törölve]				
13.	A végrehajtás helyszíne	Az összes pénzügyi eszköz esetében	Az ügylet végrehajtására szolgáló helyszín azonosítása. Uniós kereskedési helyszínen végrehajtott ügylet esetében az ISO 10383 szabvány szerinti szegmensazonosító MIC-kódot kell használni. Szegmensazonosító MIC-kód hiányában a működtetőazonosító MIC-kódot kell feltüntetni. A kereskedési helyszínen kereskedésre elfogadott vagy kereskedett pénzügyi eszközök esetében a „SINT” kódot kell használni, amennyiben az adott pénzügyi eszközre irányuló ügyletet rendszeres internalizáló útján hajtják végre. A kereskedési helyszínen kereskedésre elfogadott vagy kereskedett pénzügyi eszközök esetében a „XOFF” MIC-kódot kell használni, amennyiben az adott pénzügyi eszközre irányuló ügyletet nem uniós kereskedési helyszínen vagy rendszeres internalizáló útján hajtják végre. Ha az ügyletet az Unión kívüli szervezett kereskedési platformon hajtják végre, akkor a „XOFF” MIC-kód mellett a „Végrehajtás harmadik országbeli kereskedési helyszíne” mezőt kell kitölteni.	RM, MTF, OTF, APA	{MIC} – uniós kereskedési helyszínek vagy „SINT” – rendszeres internalizáló „XOFF” – egyéb esetben

▼M4

#	Mezőazonosító	Pénzügyi eszközök	Ismertetés és közzéteendő adatok	Végrehajtási/közzétevő helyszín típusa	Az adatszolgáltatás 1. táblázat szerinti formátuma
14.	Végrehajtás harmadik országbeli kereskedési helyszíne	Az összes pénzügyi eszköz esetében	Az ügylet végrehajtására szolgáló, harmadik országbeli kereskedési helyszín azonosítása. Az ISO 10383 szabvány szerinti szegmensazonosító MIC-kódot kell használni. Szegmensazonosító MIC-kód hiányában a működtetőazonosító MIC-kódot kell feltüntetni. Amennyiben az ügyletet nem harmadik országbeli kereskedési helyszínen hajtják végre, a mezőt nem kell kitölteni.	APA	{MIC}
15.	Közzététel dátuma és időpontja	Az összes pénzügyi eszköz esetében	Az ügylet valamely kereskedési helyszín vagy APA általi közzétételének dátuma és időpontja. A kereskedési helyszínen végrehajtott ügyletek esetében a pontosságra vonatkozó követelményeket az (EU) 2025/1155 felhatalmazáson alapuló rendelet 12. cikke határozza meg. A kereskedési helyszínen kívül végrehajtott ügyletek esetében az időpontot legalább egy másodperc pontossággal kell megadni.	RM, MTF, OTF, APA	{DATE_TIME_ FORMAT}
16.	Közzétevő helyszín	Az összes pénzügyi eszköz esetében	Az ügyletet közzétevő kereskedési helyszín vagy APA azonosító kódja.	RM, MTF, OTF, APA	{MIC}
17.	Ügyletazonosító kód	Az összes pénzügyi eszköz esetében	Az (EU) 2017/580 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet ([2]) 12. cikkének megfelelően a kereskedési helyszínek és az APA-k által az ügylethez rendelt és az adott kereskedés tekintetében a későbbiekben referenciaként használt alfanumerikus kód.	RM, MTF, OTF, APA	{ALPHA NUMERICAL-52}
18.	Elszámolandó ügylet	Származtatott termékek esetében	Azt jelző azonosító kód, hogy az ügylet elszámolása meg fog-e történni.	RM, MTF, OTF, APA	„IGAZ” – az ügylet elszámolásra kerül „HAMIS” – az ügylet nem kerül elszámolásra

▼M4

#	Mezőazonosító	Pénzügyi eszközök	Ismertetés és közzéteendő adatok	Végrehajtási/közzétevő helyszín típusa	Az adatszolgáltatás 1. táblázat szerinti formátuma
19.	Jelzések	Az összes pénzügyi eszköz esetében	Egy vagy több mezőt a vonatkozó jelzésekkel kell kitölteni a II. melléklet 3. táblázatában leírtak szerint. Amennyiben a meghatározott körülmények egyike sem áll fenn, az ügyletet jelzés nélkül kell közzétenni. Amennyiben lehetséges a jelzések kombinálása, és azokat egy mezőben kell megjeleníteni, a jelzéseket vesszővel elválasztva kell megjeleníteni.	RM, MTF, OTF, APA	A II. melléklet 3. táblázatában meghatározottak szerint
20.	Kereskedési rendszer	Az összes pénzügyi eszköz esetében	Azon kereskedési rendszer típusa, amelyen az ügyletet végrehajtották. Ha a „Végrehajtás helyszíne” mezőben „SINT” vagy „XOFF” szerepel, ezt a mezőt nem kell kitölteni.	RM, MTF, OTF	„CLOB” – központi limitáras ajánlati könyv kereskedési rendszer. „QDTS” – jegyzésvezérelt kereskedési rendszer, azaz olyan rendszer, amelyben az ügyleteket a résztvevők számára folyamatosan hozzáférhetővé tett kötelező érvényű jegyzések alapján kötik, és amelyben az árjegyzőnek olyan nagyságrendben kell ajánlatokat jegyeznie, amely megfelelő egyensúlyt biztosít a tagok és a résztvevők kereskedelmi nagyságrend iránti igénye és az árjegyző által viselt kockázat között. „PATS” – időszakos aukciós kereskedési rendszer. „RFQT” – jegyzéskérési kereskedési rendszer, azaz olyan kereskedési rendszer, amelyben a jegyzés(eke)t egy vagy több tag vagy résztvevő által benyújtott jegyzéskérésre válaszul biztosítják. A jegyzést kizárólag a kérést benyújtó tag vagy piaci résztvevő hajthatja végre. A kérést benyújtó tag vagy résztvevő a kérésére biztosított jegyzés(ek) elfogadásával hajtja végre az ügyletet.

▼M4

#	Mezőazonosító	Pénzügyi eszközök	Ismertetés és közzéteendő adatok	Végrehajtási/közzétevő helyszín típusa	Az adatszolgáltatás 1. táblázat szerinti formátuma
					„VOIC” – hangalapú kereskedési rendszer, azaz olyan kereskedési rendszer, amelyben a tagok közötti ügyleteket hangalapú módszerrel tárgyalják le. „HYBR” – hibrid kereskedési rendszer, azaz az említett kereskedési rendszerek közül kettő vagy több típusba tartozó rendszer. „OTHR” – bármely más kereskedési rendszer, azaz a fentiekben nem említett bármely más típusú kereskedési rendszer.
21.	Ügyletek száma	Állampapírok esetében	Ebben a mezőben a végrehajtott ügyletek számát kell feltüntetni, ha a 600/2014/EU rendelet 11. cikke (3) bekezdésének b) pontja több ügylet adatainak halasztott, összesített formában történő közzétételét írja elő.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/17}.

([1]) A Bizottság (EU) 2025/1155 felhatalmazáson alapuló rendelete (2025. június 12.) a 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek az összesítettadat-szolgáltatások bemeneti és kimeneti adatait, az üzleti órák összehangolását, továbbá a bevételeknek a részvények és tőzsdén kereskedett alapok esetében illetékes összesítettadat-szolgáltató általi újraelosztását meghatározó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről, valamint az (EU) 2017/574 felhatalmazáson alapuló rendelet hatályon kívül helyezéséről (HL L, 2025/1155, 3. 11. 2025, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2025/1155/oj).

([2]) A Bizottság (EU) 2017/580 felhatalmazáson alapuló rendelete (2016. június 24.) a 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek a pénzügyi eszközökre vonatkozó megbízások lényeges adatainak megőrzésére vonatkozó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről (HL L 87., 2017.3.31., 193. o., ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/580/oj).

▼M4

3. táblázat

A kereskedés utáni átláthatóság érdekében használandó jelzések jegyzéke

KERESKEDÉS UTÁNI HALASZTÁSI JELZÉSEK SZÁRMAZTATOTT TERMÉKEK ESETÉBEN			
Jelzés	Jelzés megnevezése	Végrehajtási/közzétevő helyszín típusa	Leírás
„LRGS”	Kereskedés utáni halasztásban érintett LIS ügylet jelzése	RM, MTF, OTF, APA	A szokásos piaci nagyságrendet meghaladó (LIS) ügyletek esetében a kereskedés utáni átláthatósági követelményekre vonatkozó halasztás keretében végrehajtott ügyletek
„ILQD”	Nem likvid eszközzel végrehajtott ügylet jelzése	RM, MTF, OTF, APA	A likvid piaccal nem rendelkező eszközök esetében a kereskedés utáni átláthatósági követelményekre vonatkozó halasztás keretében végrehajtott ügyletek
„SIZE”	Kereskedés utáni halasztásban érintett SSTI ügylet jelzése	RM, MTF, OTF, APA	A pénzügyi eszközre jellemző nagyságrendet meghaladó (SSTI) ügyletek esetében a kereskedés utáni átláthatósági követelményekre vonatkozó halasztás keretében végrehajtott ügyletek

KERESKEDÉS UTÁNI HALASZTÁSI JELZÉSEK KÖTVÉNYEK (KIVÉVE ETC-K ÉS ETN-EK) ESETÉBEN			
Jelzés	Jelzés megnevezése	Végrehajtási/közzétevő helyszín típusa	Leírás
MLF1	Közepes likvid jelzés	RM, MTF, OTF, APA	Az e rendelet 8a. cikke (1) bekezdésének a) pontjával összhangban likvid piaccal rendelkező pénzügyi eszközzel kapcsolatos közepes méretű ügyletekre alkalmazandó halasztásban részesülő kötvényekkel kapcsolatos ügyletek.
MIF2	Közepes illikvid jelzés	RM, MTF, OTF, APA	Az e rendelet 8a. cikke (1) bekezdésének b) pontja szerinti, likvid piaccal nem rendelkező pénzügyi eszközzel kapcsolatos közepes méretű ügyletekre alkalmazandó halasztásban részesülő kötvényekkel kapcsolatos ügyletek.
LLF3	Nagy likvid jelzés	RM, MTF, OTF, APA	Az e rendelet 8a. cikke (1) bekezdésének c) pontja szerinti, likvid piaccal rendelkező pénzügyi eszközzel kapcsolatos nagy nagyságrendű ügyletekre alkalmazandó halasztásban részesülő kötvényekkel kapcsolatos ügyletek.
LIF4	Nagy illikvid jelzés	RM, MTF, OTF, APA	Az e rendelet 8a. cikke (1) bekezdésének d) pontja szerinti, likvid piaccal nem rendelkező pénzügyi eszközzel kapcsolatos nagy nagyságrendű ügyletekre alkalmazandó halasztásban részesülő kötvényekkel kapcsolatos ügyletek.

▼M4

KERESKEDÉS UTÁNI HALASZTÁSI JELZÉSEK KÖTVÉNYEK (KIVÉVE ETC-K ÉS ETN-EK) ESETÉBEN

Jelzés	Jelzés megnevezése	Végrehajtási/közzétevő helyszín típusa	Leírás
VLF5	Nagyon nagy likvid jelzés	RM, MTF, OTF, APA	Az e rendelet 8a. cikke (1) bekezdésének e) pontja szerinti, likvid piaccal rendelkező pénzügyi eszközzel kapcsolatos nagyon nagy nagyságrendű ügyletekre alkalmazandó halasztásban részesülő kötvényekkel kapcsolatos ügyletek.
VIF5	Nagyon nagy illikvid jelzés	RM, MTF, OTF, APA	Az e rendelet 8a. cikke (1) bekezdésének e) pontja szerinti, likvid piaccal nem rendelkező pénzügyi eszközzel kapcsolatos nagyon nagy nagyságrendű ügyletekre alkalmazandó halasztásban részesülő kötvényekkel kapcsolatos ügyletek.

KERESKEDÉS UTÁNI HALASZTÁSI JELZÉSEK ETC-K, ETN-EK, SFP-K ÉS KIBOCSÁTÁSI EGYSÉGEK ESETÉBEN

Jelzés	Jelzés megnevezése	Végrehajtási/közzétevő helyszín típusa	Leírás
DEFF	Halasztás ETC-k, ETN-ek, SFP-k és kibocsátási egységek esetében	RM, MTF, OTF, APA	Az e rendelet 8a. cikkének (2) és (3) bekezdésében meghatározott, halasztásban részesülő ETC-kkel, ETN-ekkel, SFP-kkel és kibocsátási egységekkel kapcsolatos ügyletek.

A SZÁRMAZTATOTT TERMÉKEKHEZ KAPCSOLÓDÓ KIEGÉSZÍTŐ HALASZTÁSI JELZÉSEK

A 11. cikk (1) bekezdése a) pontjának i. alpontja	„LMTF”	Szűkebb körű közzététel jelzése	RM, MTF, OTF, APA	A 11. cikk (1) bekezdése a) pontjának i. alpontja szerinti, szűkebb körű adatokat közzétevő első adatszolgáltatás.
	„FULF”	Teljeskörű közzététel jelzése	RM, MTF, OTF, APA	Olyan ügylet, amely esetében a 11. cikk (1) bekezdése a) pontjának i. alpontja értelmében korábban már közzétételre kerültek a szűkebb körű adatok.
A 11. cikk (1) bekezdése a) pontjának ii. alpontja	„DATF”	Napi szinten összevont közzététel jelzése	RM, MTF, OTF, APA	A 11. cikk (1) bekezdése a) pontjának ii. alpontja szerint az ügyletek napi szinten összevont közzététele.
	„FULA”	Teljeskörű közzététel jelzése	RM, MTF, OTF, APA	Olyan egyedi ügyletek, amelyek esetében a 11. cikk (1) bekezdése a) pontjának ii. alpontja értelmében korábban már összevont közzétételre került sor.

▼M4

A SZÁRMAZTATOTT TERMÉKEKHEZ KAPCSOLÓDÓ KIEGÉSZÍTŐ HALASZTÁSI JELZÉSEK

A 11. cikk (1) bekezdésének b) pontja	„VOLO”	Hiányzó volumen jelzése	RM, MTF, OTF, APA	Olyan ügylet, amely esetében a 11. cikk (1) bekezdésének b) pontja értelmében szűkebb körű adatok kerülnek közzétételre.
	„FULV”	Teljeskörű közzététel jelzése	RM, MTF, OTF, APA	Olyan ügylet, amely esetében a 11. cikk (1) bekezdésének b) pontja értelmében korábban már közzétételre kerültek a szűkebb körű adatok.
A 11. cikk (1) bekezdésének c) pontja	„FWAF”	Négyhetes összevont közzététel jelzése	RM, MTF, OTF, APA	A 11. cikk (1) bekezdésének c) pontja szerint az ügyletek összevont közzététele.
	„FULJ”	Teljeskörű közzététel jelzése	RM, MTF, OTF, APA	Olyan egyedi ügyletek, amelyek esetében a 11. cikk (1) bekezdésének c) pontja értelmében korábban már összevont közzétételre került sor.

ÁLLAMKÖTVÉNYEKHEZ KAPCSOLÓDÓ KIEGÉSZÍTŐ HALASZTÁSI JELZÉSEK

A 11. cikk (3) bekezdésének a) pontja	„OMIS”	Hiányzó volumen jelzése	RM, MTF, OTF, APA	Olyan ügylet, amely esetében a 600/2014/EU rendelet 11. cikke (3) bekezdésének a) pontja értelmében szűkebb körű adatok kerülnek közzétételre.
	„FULO”	Teljeskörű közzététel jelzése	RM, MTF, OTF, APA	Olyan ügylet, amely esetében a 600/2014/EU rendelet 11. cikke (3) bekezdésének a) pontja értelmében már közzétételre kerültek a szűkebb körű adatok.
A 11. cikk (3) bekezdésének b) pontja	„AGFW”	Négyhetes összevont közzététel jelzése	RM, MTF, OTF, APA	A 600/2014/EU rendelet 11. cikke (3) bekezdésének b) pontja értelmében az ügyletek összevont közzététele.
	„FULG”	Teljeskörű közzététel jelzése	RM, MTF, OTF, APA	Olyan egyedi ügyletek, amelyek esetében a 600/2014/EU rendelet 11. cikke (3) bekezdésének b) pontja értelmében korábban már összevont közzétételre került sor.

EGYÉB JELZÉSEK

Jelzés	Jelzés megnevezése	Végrehajtási/közzétevő helyszín típusa	Leírás
„BENC”	Referenciaügylet jelzése	RM, MTF, OTF, APA	Minden olyan ügylet, amelyet egy adott referencia szerint számos időpont alapján számított árfolyam, pl. volumennel súlyozott átlagár vagy idővel súlyozott átlagár alapján hajtanak végre.
„NPFT”	Nem árképző ügylet jelzése	RM, MTF, OTF, APA	Az (EU) 2017/590 felhatalmazáson alapuló rendelet 2. cikkének (5) bekezdésében meghatározott nem árképző ügyletek.

▼M4

EGYÉB JELZÉSEK

Jelzés	Jelzés megnevezése	Végrehajtási/közzétevő helyszín típusa	Leírás
„TPAC”	Ügyletcsomag jelzése	RM, MTF, OTF, APA	A 600/2014/EU rendelet 2. cikke (1) bekezdése 50. pontjának b) alpontja szerinti fizikai teljesítéstől függő (EFP) ügyletnek nem minősülő ügyletcsomagok.
„XFPH”	Fizikai teljesítéstől függő (EFP) ügylet jelzése	RM, MTF, OTF, APA	A 600/2014/EU rendelet 2. cikke (1) bekezdésének 48. pontja szerinti fizikai teljesítéstől függő (EFP) ügylet.
„CANC”	Törlés jelzése	RM, MTF, OTF, APA	Korábban közzétett ügylet törlése esetén kell feltüntetni.
„AMND”	Módosítás jelzése	RM, MTF, OTF, APA	Korábban közzétett ügylet módosítása esetén kell feltüntetni.
„PORT”	Portfolióügylet jelzése	RM, MTF, OTF, APA	Öt vagy több különböző pénzügyi eszközzel való kereskedés, amely esetében a kereskedés azonos időben és ugyanazon ügyfél által, egyetlen tételáron történik, és amely nem minősül a 600/2014/EU rendelet 2. cikke (1) bekezdésének 50. pontja szerinti „ügyletcsomagnak”.
„MTCH”	Saját kitettség nélküli ügyletpárosítás jelzése	OTF	A 2014/65/EU irányelv 4. cikke (1) bekezdésének 38. pontjában meghatározott saját kitettség nélküli ügyletpárosítás.
„NEGO”	Előre letárgyalt ügylet jelzése	RM, MTF, OTF	Bizalmasan letárgyalt, ugyanakkor a kereskedési helyszín szabályai szerint bejelentett ügylet.

▼M3

4. táblázat

A volumen mérőszámai

Eszköz típusa	Volumen
Minden kötvény, kivéve ETC, ETN és strukturált pénzügyi termékek	A kereskedett szerződés „névleges összege” az e rendelet II. melléklete 2. táblázatának 10. mezője szerint.
ETC és ETN kötvénytípusok	A kereskedett szerződés „névleges összege” az e rendelet II. melléklete 2. táblázatának 10. mezője szerint.
Értékpapírosított származtatott ügyletek	A kereskedett szerződés „névleges összege” az e rendelet II. melléklete 2. táblázatának 10. mezője szerint.
Származtatott kamatügyletek	A kereskedett szerződés „névleges összege” az e rendelet II. melléklete 2. táblázatának 10. mezője szerint.
Származtatott devizaügyletek	A kereskedett szerződés „névleges összege” az e rendelet II. melléklete 2. táblázatának 10. mezője szerint.
Származtatott részvényügyletek	A kereskedett szerződés „névleges összege” az e rendelet II. melléklete 2. táblázatának 10. mezője szerint.
Származtatott áruügyletek	A kereskedett szerződés „névleges összege” az e rendelet II. melléklete 2. táblázatának 10. mezője szerint.
Származtatott hitelügyletek	A kereskedett szerződés „névleges összege” az e rendelet II. melléklete 2. táblázatának 10. mezője szerint.
Különbözeti ügyletek	A kereskedett szerződés „névleges összege” az e rendelet II. melléklete 2. táblázatának 10. mezője szerint.
„C10” típusú származtatott ügyletek	A kereskedett szerződés „névleges összege” az e rendelet II. melléklete 2. táblázatának 10. mezője szerint.
Kibocsátáskereskedelmi derivatívák	A kereskedett szerződés „mértékegységben kifejezett mennyisége” az e rendelet II. melléklete 2. táblázatának 8. mezője szerint.
Kibocsátási egységek	A kereskedett szerződés „mértékegységben kifejezett mennyisége” az e rendelet II. melléklete 2. táblázatának 8. mezője szerint.

▼B

III. MELLÉKLET

Nem tulajdonviszonyt megtestesítő pénzügyi eszközök likviditásértékelése, valamint LIS és SSTI küszöbértékei

▼M4

1. **E melléklet alkalmazásában:**

1. A 2.2. táblázatban a forgalomban lévő kötvénykibocsátás nagyságrendje a kibocsátott és jelenleg befektetők által tartott kötvények teljes értékére vonatkozik.

2. Az „eszközosztály” kifejezés a következő pénzügyieszköz-kategóriákra utal: kötvények, strukturált pénzügyi termékek, értékpapírosított származtatott ügyletek, származtatott kamatügyletek, származtatott részvényügyletek, származtatott áruügyletek, származtatott devizaügyletek, származtatott hitelügyletek, „C10” típusú származtatott ügyletek, CFD-k, kibocsátási egységek és kibocsátáskereskedelmi derivatívák.

3. Az „eszköz-alosztály” kifejezés az eszközosztálynak a szerződés, illetve az alapeszköz típusa alapján leszűkített részegységére utal.

4. Az „alkategória” kifejezés az eszköz-alosztálynak az e melléklet 2.2–13.3. táblázata szerinti további minőségi szegmentálási kritériumok alapján leszűkített részegységére utal.

5. Az „átlagos napi névleges összeg” (ADNA) kifejezés az adott pénzügyi eszköznek a II. melléklet 4. táblázatában előírt volumen-mérőszám alapján meghatározott és a 13. cikk (7) bekezdésében előírt időszakban végrehajtott, az adott időszak – vagy adott esetben az év azon része, amely során a pénzügyi eszközt a kereskedési helyszínen kereskedésre elfogadták vagy azzal kereskedtek, és a pénzügyi eszköz kereskedése nem volt felfüggesztés alatt – kereskedési napjainak számával elosztott teljes forgalmát jelenti.

6. Az „átlagos napi ügyletszám” az adott pénzügyi eszköz vonatkozásában a 13. cikk (7) bekezdésében előírt időszakban végrehajtott ügyletek teljes száma, osztva az adott időszak – vagy adott esetben az év azon része, amely során a pénzügyi eszközt a kereskedési helyszínen kereskedésre elfogadták vagy azzal kereskedtek, és a pénzügyi eszköz kereskedése nem volt felfüggesztés alatt – kereskedési napjainak számával.

7. A „határidős tőzsdei ügylet” kifejezés egy árucikknek vagy pénzügyi eszköznek egy kijelölt jövőbeni időpontban, a szerződéskötés idején az eladó és a vevő által kikötött megegyezéses áron történő vételére vagy eladására vonatkozó szerződést jelent. A határidős tőzsdei ügylet általános szerződési feltételei minden esetben meghatározzák az adásvétel minimális mennyiségét és minőségét, azt a legkisebb mennyiséget, amelytől árváltozás lehetséges, az átadási eljárást, a lejárat időpontját és a szerződés egyéb különös jellemzőit.

8. Az „opciós ügylet” kifejezés olyan szerződést jelent, amely feljogosítja, de nem kötelezi a tulajdonost arra, hogy egy bizonyos pénzügyi eszközt vagy árucikket egy adott jövőbeni időpontban vagy lehívási napon, illetve az addig tartó időszakon belül, előre megszabott áron, illetve kötési vagy lehívási árfolyamon eladjon (put opció) vagy megvásároljon (call opció).

9. A „csereügylet” („swap-ügylet”) kifejezés olyan szerződést jelent, amely keretében két fél megállapodik abban, hogy valamely pénzügyi eszköz pénzforgalmát egy bizonyos jövőbeni időpontban egy másik pénzügyi eszközére cseréli.

10. A „portfólió-csereügylet” kifejezés olyan szerződést jelent, amely keretében a végfelhasználók többszörös csereügyleteket hajthatnak végre.

▼**M4**

11. A „tőzsdén kívüli határidős ügylet” („forward”) kifejezés egy árucikknek vagy pénzügyi eszköznek egy kijelölt jövőbeni időpontban, a szerződéskötés idején az eladó és a vevő által kikötött megegyezéses áron történő vételére vagy eladására vonatkozó, két fél között kötött magánmegállapodást jelenti.

12. A „csereügyletre szóló opció” (swaption) vagy „csereügylet-alapú opció” (option on a swap) kifejezés olyan szerződést jelent, amely feljogosítja, de nem kötelezi a tulajdonost arra, hogy egy adott jövőbeni időpontban vagy lehívási napon, illetve az addig tartó időszakon belül csereügyletet hajtson végre.

13. A „határidős tőzsdei csereügylet” kifejezés olyan határidős tőzsdei ügyletet jelent, amely kötelezi a tulajdonost arra, hogy egy adott jövőbeni időpontban, illetve az addig tartó időszakon belül csereügyletet hajtson végre.

14. A „tőzsdén kívüli határidős csereügylet” kifejezés olyan tőzsdén kívüli határidős ügyletet jelent, amely kötelezi a tulajdonost arra, hogy egy adott jövőbeni időpontban, illetve az addig tartó időszakon belül csereügyletet hajtson végre.

▼M4

2. **Kötvények**

2.2. táblázat

Kötvények (minden kötvénytípus, kivéve ETC és ETN) – likvid piaccal nem rendelkező osztályok

Minden egyes kötvény esetében meg kell határozni, hogy a 6a. cikk szerint nem rendelkezik likvid piaccal, ha az alábbi táblázatok soraiban meghatározott kötvényjellemzők bizonyos kombinációja jellemzi.

Államkötvények és egyéb közintézményi kötvények						
Csoporta-zonosító	**MiFIR-azonosító**	**Kötvénytípus**	**Kibocsátó vagy kibocsátó ország**	**Hátralévő futamidő**	**Kamatszelvény típusa**	**Kibocsátás nagyságrendje**
	RTS2#3	RTS2#9	Az (EU) 2017/585 bizottsági felhatalmazáson alapuló rendelet ([1]) („RTS23”) „A kibocsátó vagy a kereskedési helyszín működtetőjének azonosítója” mezőjében feltüntetett kibocsátó ország	Az RTS23 „Lejárat dátuma” mezőben feltüntetett lejárati időpontig hátralévő idő	Az RTS23 „Eszközbe-sorolás” mezőben feltüntetett CFI-kód harmadik betűje	Az RTS23 „Teljes kibocsátott névleges összeg” mező EUR-ra átszámítva
G1	KÖTVÉ-NY	EUSB Az EUSB olyan nem átváltható és nem fedezett kötvény, amelyet valamely alábbi állampapír-kibocsátó bocsát ki: a) az Unió; b) valamely tagállam, ideértve annak kormányzati szervét, ügynökségét vagy különleges célú gazdasági egységét; c) a szövetségi államformával rendelkező tagállamok esetében a szövetség tagjai; d) több tagállam közös, különleges célú gazdasági egysége; e) két vagy több tagállam által finanszírozás mobilizálása, valamint súlyos finanszírozási problémákkal küzdő vagy finanszírozási szempontból veszélyeztetett tagjai számára pénzügyi segítségnyújtás céljából alapított nemzetközi pénzügyi intézmény; f) az Európai Beruházási Bank; g) harmadik ország állami szervezeti egysége.	A kibocsátó ország tagállam, az Amerikai Egyesült Államok vagy az Egyesült Királyság; VAGY A kibocsátó az Unió.	Legfeljebb 10 éves	F (fix kamatszelvény)	Kevesebb mint 5 000 000 000 EUR
G2	KÖTVÉ-NY	EUSB vagy OEPB Az OEPB olyan nem átváltható és nem fedezett kötvény, amelyet valamely alábbi nem állampapír-kibocsátó közintézmény bocsát ki.	A G1-ben nem szereplő eszközök			Kevesebb mint 1 000 000 000 EUR

([1]) 1 A Bizottság (EU) 2017/585 felhatalmazáson alapuló rendelete (2016. július 14.) a 600/2014/EU európai parlamenti és tanácsi rendeletnek a pénzügyi eszközökre vonatkozó referenciaadatok adatstandardjaira és -formátumaira, valamint az Európai Értékpapírpiaci Hatóság és az illetékes hatóságok által kialakítandó mechanizmusokkal kapcsolatban szükséges technikai intézkedésekre vonatkozó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről (HL L 87., 2017.3.31., 368. o., ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/585/oj).

▼M4

Vállalati, átváltható és egyéb kötvények					
Csoportazonosító	**MiFIR-azonosító**	**Kötvénytípus**	**Pénznem**	**Hitelminősítés**	**Kibocsátás nagyságrendje**
	RTS2#3	RTS2#9	Az RTS23 „Névleges pénznem 1” mezőjében feltüntetett eszköz pénzneme		Az RTS23 „Teljes kibocsátott névleges összeg” mező EUR-ra átszámítva
G3	KÖTVÉNY	CRPB, CVTB vagy OTHR A CRPB olyan nem átváltható és nem fedezett kötvény, amelyet a 2157/2001/EK tanácsi rendelettel ([1]) összhangban létrehozott Societas Europaea vagy a 2013/34/EU európai parlamenti és tanácsi irányelv ([2]) I. vagy II. mellékletében felsorolt vagy azzal egyenértékű harmadik országbeli társaság bocsátott ki. A CVTB kötvényből vagy értékpapírosított hitelviszonyt megtestesítő eszközből és egy beágyazott származtatott termékből (például az alapul szolgáló részvény vásárlási opciójából) felépülő eszköz.	EUR, GBP, USD	Befektetésre ajánlott	Kevesebb mint 500 000 000 EUR
G4	KÖTVÉNY	CRPB, CVTB vagy OTHR	A G3-ban nem szereplő eszközök		Kevesebb mint 500 000 000 EUR

([1]) A Tanács 2157/2001/EK rendelete (2001. október 8.) az európai részvénytársaság (SE) statútumáról (HL L 294., 2001.11.10., 1. o., ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2001/2157/oj).
([2]) Az Európai Parlament és a Tanács 2013/34/EU irányelve (2013. június 26.) a meghatározott típusú vállalkozások éves pénzügyi kimutatásairól, összevont (konszolidált) éves pénzügyi kimutatásairól és a kapcsolódó beszámolókról, a 2006/43/EK európai parlamenti és tanácsi irányelv módosításáról, valamint a 78/660/EGK és a 83/349/EGK tanácsi irányelv hatályon kívül helyezéséről (HL L 182., 2013.6.29., 19. o., ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2013/34/oj).

Fedezett kötvények			
Csoportazonosító	**MiFIR-azonosító**	**Kötvénytípus**	**Kibocsátás nagyságrendje**
	RTS2#3	RTS2#9	Az RTS23 „Teljes kibocsátott névleges összeg” mező EUR-ra átszámítva
G5	KÖTVÉNY	CVDB CVDB: a 2009/65/EK európai parlamenti és tanácsi irányelv [1] 52. cikkének ([1]) bekezdésében említett kötvények	Kevesebb mint 500 000 000 EUR

([1]) Az Európai Parlament és a Tanács 2009/65/EK irányelve (2009. július 13.) az átruházható értékpapírokkal foglalkozó kollektív befektetési vállalkozásokra (ÁÉKBV) vonatkozó törvényi, rendeleti és közigazgatási rendelkezések összehangolásáról (HL L 302., 2009.11.17., 32. o., ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2009/65/oj).

▼M4

2.3. táblázat

Kötvények (minden kötvénytípus, kivéve ETC és ETN) – kereskedés előtti LIS küszöbértékek

Eszközosztály – Kötvények (minden kötvénytípus, kivéve ETC és ETN)	
Kötvénytípus	**Kereskedés előtti LIS**
Államkötvény és egyéb közintézményi kötvény	5 000 000 EUR
Vállalati kötvény, átváltható kötvény és egyéb kötvény	1 000 000 EUR
Fedezett kötvény	5 000 000 EUR

2.4. táblázat

Kötvények (ETC és ETN kötvénytípus) – likvid piaccal nem rendelkező osztályok

Eszközosztály – Kötvények (ETC és ETN kötvénytípus)	
A 6a. cikk alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározásához a következő módszert kell alkalmazni:	
Tőzsdén kereskedett áruk (ETC) – RTS2#3 = ETCS: a kibocsátó által árucikkekben vagy származtatott áruügyletekben eszközölt közvetlen befektetés ellenében kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő eszköz. Az ETC árfolyama közvetlenül vagy közvetve kapcsolódik az alaptermék teljesítményéhez. Az ETC passzívan követi az alapjául szolgáló árucikk vagy áruindex teljesítményét.	Minden ETC likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül.
Tőzsdén kereskedett kötvények (ETN) – RTS2#3 = ETNS: a kibocsátó által az alaptermékben vagy az alapul szolgáló származtatott termékben eszközölt közvetlen befektetés ellenében kibocsátott hitelviszonyt megtestesítő eszköz. Az ETN árfolyama közvetlenül vagy közvetve kapcsolódik az alaptermék teljesítményéhez. Az ETN passzívan követi az alapjául szolgáló termék teljesítményét.	Minden ETN likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül.

2.5. táblázat

Kötvények (ETC és ETN kötvénytípus) – kereskedés előtti LIS küszöbérték

Eszközosztály – Kötvények (ETC és ETN kötvénytípus)	
Kötvénytípus	**Kereskedés előtti LIS**
ETC	1 000 000 EUR
ETN	1 000 000 EUR

▼M4

2.6. táblázat

Kötvények (minden kötvénytípus, kivéve ETC és ETN) – halasztási rendszer

Eszközosztály – Kötvények (minden kötvénytípus, kivéve ETC és ETN)			
Kötvénytípus	**Kategória**	**Likviditás**	**Nagyságrend (magasabb vagy egyenlő)**
Államkötvény a G1-ben a 2.2. táblázat szerint	1.	Likvid piaccal rendelkezőnek minősül	15 000 000 EUR
	2.	Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül	5 000 000 EUR
	3.	Likvid piaccal rendelkezőnek minősül	50 000 000 EUR
	4.	Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül	15 000 000 EUR
	5.	Likvid piaccal rendelkezőnek minősül	100 000 000 EUR
	5.	Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül	50 000 000 EUR
Államkötvény és egyéb közintézményi kötvény a G2-ben a 2.2. táblázat szerint	1.	Likvid piaccal rendelkezőnek minősül	10 000 000 EUR
	2.	Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül	1 000 000 EUR
	3.	Likvid piaccal rendelkezőnek minősül	20 000 000 EUR
	4.	Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül	2 000 000 EUR
	5.	Likvid piaccal rendelkezőnek minősül	50 000 000 EUR
	5.	Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül	5 000 000 EUR
Vállalati kötvény, átváltható kötvény és egyéb kötvény a G3-ban a 2.2. táblázat szerint	1.	Likvid piaccal rendelkezőnek minősül	1 500 000 EUR
	2.	Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül	500 000 EUR
	3.	Likvid piaccal rendelkezőnek minősül	7 500 000 EUR
	4.	Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül	2 000 000 EUR
	5.	Likvid piaccal rendelkezőnek minősül	15 000 000 EUR
	5.	Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül	5 000 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Kötvények (minden kötvénytípus, kivéve ETC és ETN)			
Kötvénytípus	**Kategória**	**Likviditás**	**Nagyságrend (magasabb vagy egyenlő)**
Vállalati kötvény, átváltható kötvény és egyéb kötvény a G4-ben a 2.2. táblázat szerint	1.	Likvid piaccal rendelkezőnek minősül	1 000 000 EUR
	2.	Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül	500 000 EUR
	3.	Likvid piaccal rendelkezőnek minősül	5 000 000 EUR
	4.	Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül	2 000 000 EUR
	5.	Likvid piaccal rendelkezőnek minősül	10 000 000 EUR
	5.	Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül	5 000 000 EUR
Fedezett kötvények a G5-ben a 2.2. táblázat szerint	1.	Likvid piaccal rendelkezőnek minősül	5 000 000 EUR
	2.	Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül	1 000 000 EUR
	3.	Likvid piaccal rendelkezőnek minősül	20 000 000 EUR
	4.	Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül	5 000 000 EUR
	5.	Likvid piaccal rendelkezőnek minősül	50 000 000 EUR
	5.	Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül	10 000 000 EUR

3. **Strukturált pénzügyi termékek (SFP)**

3.1. táblázat

SFP – Likvid piaccal nem rendelkező osztályok

Eszközosztály – Strukturált pénzügyi termékek (SFP)
A strukturált pénzügyi termékek eszközosztályának értékelése a 6a. cikk alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyi eszközök meghatározása céljából – RTS2#3 = SFPS.
Minden SFP likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül

3.2. táblázat

SFP – Kereskedés előtti LIS küszöbérték

Eszközosztály – Strukturált pénzügyi termékek (SFP)
Kereskedés előtti LIS
250 000 EUR

▼B

4. **Értékpapírosított származtatott ügyletek**

▼M3

4.1. táblázat

Értékpapírosított származtatott ügyletek – Likvid piaccal nem rendelkező osztályok

Eszközosztály – Értékpapírosított származtatott ügyletek
A 2014/65/EU irányelv 4. cikke (1) bekezdése 44. pontjának c) alpontjában meghatározott, strukturált pénzügyi terméknek nem minősülő átruházható értékpapír, amely legalább a következőket tartalmazza: a.1) egyszerű (plain vanilla) fedezett opciós utalványok, azaz olyan, pénzügyi intézmény által kibocsátott értékpapírok, amelyek jogot, de nem kötelezettséget biztosítanak birtokosuknak arra, hogy a) a lejárat napján, illetve a lejárat napjáig megvásárolja az alapul szolgáló eszköz egy meghatározott mennyiségét előre megszabott kötési árfolyamon, illetve ha készpénzes elszámolásról állapodtak meg, az eladó kifizesse számára az aktuális piaci ár és a kötési ár pozitív különbözetét; vagy b) a lejárat napján, illetve a lejárat napjáig eladja az alapul szolgáló eszköz egy meghatározott összegét előre megszabott kötési árfolyamon, illetve ha készpénzes elszámolásról állapodtak meg, a vevő kifizesse számára a kötési ár és az aktuális piaci ár pozitív különbözetét; a.2) opciós utalványok, azaz olyan értékpapírok, amelyeket az alapul szolgáló eszköz kibocsátója bocsátott ki, és amelyek jogot, de nem kötelezettséget biztosítanak birtokosuknak arra, hogy a) a lejárat napján, illetve a lejárat napjáig megvásárolja az alapul szolgáló eszköz egy meghatározott összegét előre megszabott kötési árfolyamon, illetve ha készpénzes elszámolásról állapodtak meg, az eladó kifizesse számára az aktuális piaci ár és a kötési ár pozitív különbözetét; vagy b) a lejárat napján, illetve a lejárat napjáig eladja az alapul szolgáló eszköz egy meghatározott összegét előre megszabott kötési árfolyamon, illetve ha készpénzes elszámolásról állapodtak meg, a vevő kifizesse számára a kötési ár és az aktuális piaci ár pozitív különbözetét; b) tőkeáttételi certifikátok, azaz olyan certifikátok, amelyek tőkeáttételi hatást kiváltva követik az alapul szolgáló eszköz teljesítményét; c) „egzotikus” fedezett opciós utalványok, azaz olyan fedezett opciós utalványok, amelyek fő alkotóeleme egy opciókombináció; d) olyan átruházható jogok, amelyek alapul szolgáló eszköze nem tulajdonviszonyt megtestesítő eszköz; e) befektetési certifikátok, azaz olyan certifikátok, amelyek tőkeáttételi hatás kiváltása nélkül követik az alapul szolgáló eszköz teljesítményét. RTS2#3 = SDRV
A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében a következő módszertant kell alkalmazni
Minden értékpapírosított származtatott ügylet likvid piaccal rendelkezőnek minősül.

▼M4

4.2. táblázat

Értékpapírosított származtatott ügyletek – kereskedés előtti és utáni SSTI és LIS küszöbértékek

Eszközosztály – Értékpapírosított származtatott ügyletek		
Kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek		
Kereskedés előtti LIS	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

▼B

5. **Származtatott kamatügyletek**

▼M3

5.1. táblázat

Származtatott kamatügyletek – Likvid piaccal nem rendelkező osztályok

Eszközosztály – Származtatott kamatügyletek
A 2014/65/EU irányelv I. melléklete C. szakaszának 4. pontjában meghatározott szerződés, amelynek végső alapterméke kamat, kamatlábat tartalmazó kötvény, kölcsön vagy bármilyen kosár, portfólió vagy index; illetve kamatláb, kötvény vagy kölcsön teljesítményéhez kötött kötvény, kölcsön vagy bármilyen egyéb termék.

Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.**		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
Határidős tőzsdei kötvényügyletek és tőzsdén kívüli határidős kötvényügyletek **/Határidős tőzsdei kötvényügyletre vonatkozó határidős tőzsdei ügyletek**	A határidős tőzsdei kötvényügyletek és tőzsdén kívüli határidős kötvényügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS2#17) — az alaptermék kibocsátója **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#18) – az alapul szolgáló leszállításos kötvény futamideje a következő meghatározás szerint:**Rövid lejáratú**: amennyiben az alapul szolgáló leszállításos kötvény futamideje legfeljebb 4 év, az rövid lejáratúnak minősül.	5 000 000 EUR	10	Amennyiben az alkategória egy adott lejárati csoport tekintetében likvid piaccal rendelkezőnek minősül, és a következő lejárati csoport által meghatározott alkategória likvid piaccal nem

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
/Határidős tőzsdei kötvényügyletre vonatkozó tőzsdén kívüli határidős ügyletekHatáridős tőzsdei kötvényügyletek **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = BOND** **vagy** **Tőzsdén kívüli határidős kötvényügyletek** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FORW** **RTS2#16 = BOND** **vagy** **Határidős tőzsdei kötvényügyletre vonatkozó határidős tőzsdei ügyletek** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR**	**Középlejáratú**: amennyiben az alapul szolgáló leszállításos kötvény futamideje 4–8 év, az középlejáratúnak minősül. **Hosszú lejáratú**: amennyiben az alapul szolgáló leszállításos kötvény futamideje 8–15 év, az hosszú lejáratúnak minősül. **Ultrahosszú lejáratú**: amennyiben az alapul szolgáló leszállításos kötvény futamideje meghaladja a 15 évet, az ultrahosszú lejáratúnak minősül. **3. szegmentációs kritérium** – a határidős tőzsdei ügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: 1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 3 hónap 2. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap 3. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év 4. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év 5. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év … m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év			rendelkezőnek minősül, az első távolabbi lejáratú szerződést két héttel a legközelebbi lejáratú szerződés lejárta előtt likvid piaccal rendelkezőnek kell tekinteni.

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
RTS2#5 = FUTR **RTS2#16 = BNFD** **vagy** **Határidős tőzsdei kötvényügyletre vonatkozó tőzsdén kívüli határidős ügyletek** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FORW** **RTS2#16 = BNFD**				
Kötvényopciók **/Kötvényopcióra vonatkozó opciók** **/Határidős tőzsdei kötvényügyletre vonatkozó opciók** **Kötvényopciók** **Kötvényopcióra vonatkozó opciók** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR**	A kötvényopciók alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. Szegmentációs kritérium** (RTS2#22) – a végső alapul szolgáló kötvény **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – az opció lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: 1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 3 hónap 2. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap 3. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év 4. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év 5. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év … m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év	5 000 000 EUR	10	

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
RTS2#5 = OPTN **RTS2#16 = BOND** **vagy** **Kötvényopcióra vonatkozó opciók** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = BOND** **vagy** **Határidős tőzsdei kötvényügyletre vonatkozó opciók** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = BNFD**				

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
Határidős tőzsdei kamatlábügyletek (IR) és tőzsdén kívüli határidős kamatláb-megállapodások (FRA / Határidős tőzsdei kamatlábügyletekre vonatkozó határidős tőzsdei ügyletek / Határidős tőzsdei kamatlábügyletekre vonatkozó tőzsdén kívüli határidős kamatláb-megállapodások **Határidős tőzsdei kamatlábügyletek** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = INTR** **vagy** **Tőzsdén kívüli határidős kamatláb-megállapodások** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FRAS** **RTS2#16 = INTR** **vagy** **Határidős tőzsdei kamatlábügyletekre vonatkozó határidős tőzsdei ügyletek**	A határidős tőzsdei kamatlábügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS2#24)) – az alapul szolgáló kamatláb **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#25) – az alapul szolgáló kamatláb futamideje **3. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a határidős ügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: 1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 3 hónap 2. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap 3. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év 4. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év 5. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év … m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év	500 000 000 EUR	10	Amennyiben az alkategória egy adott lejárati csoport tekintetében likvid piaccal rendelkezőnek minősül, és a következő lejárati csoport által meghatározott alkategória likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül, az első távolabbi lejáratú szerződést két héttel a legközelebbi lejáratú szerződés lejárta előtt likvid piaccal rendelkezőnek kell tekinteni.

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
RTS2#3 = DERV **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = IFUT** **vagy** **Határidős tőzsdei kamatlábügyletekre vonatkozó tőzsdén kívüli határidős kamatláb-megállapodások** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FRAS** **RTS2#16 = IFUT**				
Kamatlábopciók **/ Határidős tőzsdei kamatlábügyletekre és tőzsdén kívüli határidős kamatláb-megállapodásokra (FRA) vonatkozó opciók** **/ Kamatlábopciókra vonatkozó opciók**	A kamatlábopciók alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS2#24)) – az alapul szolgáló kamatláb **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#25) – az alapul szolgáló kamatláb futamideje **3. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – az opció lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: 1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 3 hónap	500 000 000 EUR	10	

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
/ Határidős tőzsdei kamatlábügyletekre és tőzsdén kívüli határidős kamatláb-megállapodásokra (FRA) vonatkozó opciókra vonatkozó opciók **Határidős tőzsdei kamatlábügyletekre és tőzsdén kívüli határidős kamatláb-megállapodásokra (FRA) vonatkozó opciók / Kamatlábopciókra vonatkozó opciók** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = IFUT** **vagy** **Kamatlábopciók / Határidős tőzsdei kamatlábügyletekre és tőzsdén kívüli határidős kamatláb-megállapodásokra (FRA) vonatkozó opciókra vonatkozó opciók** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = INTR**	2. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap 3. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év 4. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év 5. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év … m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év			

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
Csereügyletre szóló opciók **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = SWPT**	A csereügyletre szóló opciók alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS2#16) – az alapul szolgáló csereügylet típusa a következő meghatározás szerint: egydevizás rögzítettkamat-csereügylet, egydevizás rögzítettkamat-csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek [**RTS2#16 = XXSC**] egydevizás rögzített–változó kamatcsereügylet, egydevizás rögzített–változó kamatcsereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek [**RTS2#16 = XFSC**] egydevizás változókamat-csereügylet, egydevizás változókamat-csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek [**RTS2#16 = FFSC**] egydevizás inflációs csereügylet, egydevizás inflációs csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek [**RTS2#16 = IFSC**] egydevizás OIS csereügylet, egydevizás OIS csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek [**RTS2#16 = OSSC**] többdevizás rögzítettkamat-csereügylet, többdevizás rögzítettkamat-csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek [**RTS2#16 = XXMC**]	500 000 000 EUR	10	

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
	többdevizás rögzített–változó kamatcsereügylet, többdevizás rögzített–változó kamatcsereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek [**RTS2#16 = XFMC**]			
	többdevizás változókamat-csereügylet, többdevizás változókamat-csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek [**RTS2#16 = FFMC**]			
	többdevizás inflációs csereügylet, többdevizás inflációs csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek [**RTS2#16 = IFMC**]			
	többdevizás OIS csereügylet, többdevizás OIS csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek [**RTS2#16 = OSMC**]			
	2. szegmentációs kritérium (RTS2#20) – névleges pénznem, azaz azon pénznem, amelyben az opciós ügylet névleges értéke denominált			
	3. szegmentációs kritérium (RTS2#22 vagy RTS2#23) – inflációs index, amennyiben az alapul szolgáló csereügylet típusa egydevizás inflációs csereügylet vagy többdevizás inflációs csereügylet			
	4. szegmentációs kritérium (RTS2#21) – a csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint:			
	1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 1 hónap			
	2. lejárati csoport: 1 hónap < futamidő ≤ 3 hónap			

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
	3. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap 4. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év 5. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év 6. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év … m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év **5. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – az opció lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: **1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 6 hónap **2. lejárati csoport**: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év **3. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év **4. lejárati csoport**: 2 év < futamidő ≤ 5 év **5. lejárati csoport**: 5 év < futamidő ≤ 10 év **6. lejárati csoport**: 10 éven túli			

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
Többdevizás rögzített–változó csereügyletek, valamint többdevizás rögzített–változó csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek, tőzsdén kívüli határidős ügyletek, opciók Olyan csereügyletek, illetve azokon alapuló határidős tőzsdei ügyletek, tőzsdén kívüli határidős ügyletek és opciók, amelyek esetében a két fél különböző pénznemben denominált pénzforgalmat cserél, és ahol az egyik láb pénzforgalmát rögzített kamatláb, a másik láb pénzforgalmát változó kamatláb határozza meg. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP vagy FONS vagy FWOS vagy OPTS RTS2#16 = XFMC	A többdevizás rögzített–változó kamatcsereügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#13 és RTS23#42) – névleges devizapár, azaz azon két pénznem kombinációja, amelyekben a csereügylet két lába denominált **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: 1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 1 hónap 2. lejárati csoport: 1 hónap < futamidő ≤ 3 hónap 3. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap 4. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év 5. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év 6. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év … m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
Többdevizás változókamat-csereügyletek, valamint többdevizás változókamat-csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek, tőzsdén kívüli határidős ügyletek, opciók Olyan csereügyletek, illetve azokon alapuló határidős tőzsdei ügyletek, tőzsdén kívüli határidős ügyletek és opciók, amelyek esetében a két fél különböző pénznemben denominált pénzforgalmat cserél, és ahol mindkét láb pénzforgalmát változó kamatláb határozza meg. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP vagy FONS vagy FWOS vagy OPTS RTS2#16 = FFMC	A többdevizás változókamat-csereügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#13 és RTS23#42) – névleges devizapár, azaz azon két pénznem kombinációja, amelyekben a csereügylet két lába denominált **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: 1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 1 hónap 2. lejárati csoport: 1 hónap < futamidő ≤ 3 hónap 3. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap 4. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év 5. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év 6. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év … m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
Többdevizás rögzítettkamat-csereügyletek, valamint többdevizás rögzítettkamat-csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek, tőzsdén kívüli határidős ügyletek, opciók Olyan csereügyletek, illetve azokon alapuló határidős tőzsdei ügyletek, tőzsdén kívüli határidős ügyletek és opciók, amelyek esetében a két fél különböző pénznemben denominált pénzforgalmat cserél, és ahol mindkét láb pénzforgalmát rögzített kamatláb határozza meg. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP vagy FONS vagy FWOS vagy OPTS RTS2#16 = XXMC	A többdevizás rögzítettkamat-csereügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#13 és RTS23#42) – névleges devizapár, azaz azon két pénznem kombinációja, amelyekben a csereügylet két lába denominált **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: 1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 1 hónap 2. lejárati csoport: 1 hónap < futamidő ≤ 3 hónap 3. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap 4. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év 5. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év 6. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év … m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
Többdevizás egynapos indexált csereügyletek (Overnight Index Swap, OIS), valamint többdevizás egynapos indexált csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek, tőzsdén kívüli határidős ügyletek, opciók Olyan csereügyletek, illetve azokon alapuló határidős tőzsdei ügyletek, tőzsdén kívüli határidős ügyletek és opciók amelyek esetében a két fél különböző pénznemben denominált pénzforgalmat cserél, és ahol legalább az egyik láb pénzforgalmát OIS kamatláb határozza meg. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP vagy FONS vagy FWOS vagy OPTS RTS2#16 = OSMC	A többdevizás egynapos indexált csereügyletek (OIS) alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#13 és RTS23#42) – névleges devizapár, azaz azon két pénznem kombinációja, amelyekben a csereügylet két lába denominált **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: 1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 1 hónap 2. lejárati csoport: 1 hónap < futamidő ≤ 3 hónap 3. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap 4. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év 5. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év 6. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év … m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
Többdevizás inflációs csereügyletek, valamint többdevizás inflációs csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek, tőzsdén kívüli határidős ügyletek, opciók Olyan csereügyletek, illetve azokon alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek, amelyek esetében a két fél különböző pénznemben denominált pénzforgalmat cserél, és ahol legalább az egyik láb pénzforgalmát inflációs ráta határozza meg. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP vagy FONS vagy FWOS vagy OPTS RTS2#16 = IFMC	A többdevizás inflációs csereügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#13 és RTS23#42) – névleges devizapár, azaz azon két pénznem kombinációja, amelyekben a csereügylet két lába denominált **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: 1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 1 hónap 2. lejárati csoport: 1 hónap < futamidő ≤ 3 hónap 3. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap 4. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év 5. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év 6. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év … m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
Egydevizás rögzített–változó csereügyletek, valamint egydevizás rögzített–változó csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek, tőzsdén kívüli határidős ügyletek, opciók Olyan csereügyletek, illetve azokon alapuló határidős tőzsdei ügyletek, tőzsdén kívüli határidős ügyletek és opciók, amelyek esetében a két fél azonos pénznemben denominált pénzforgalmat cserél, és ahol az egyik láb pénzforgalmát rögzített, a másikét pedig változó kamatláb határozza meg. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP vagy FONS vagy FWOS vagy OPTS RTS2#16 = XFSC	Az egydevizás rögzített–változó csereügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#13) – azon névleges pénznem, amelyben a csereügylet két lába denominált **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: 1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 1 hónap 2. lejárati csoport: 1 hónap < futamidő ≤ 3 hónap 3. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap 4. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év 5. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év 6. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év … m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
Egydevizás változókamat-csereügyletek, valamint egydevizás változókamat-csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek, tőzsdén kívüli határidős ügyletek, opciók Olyan csereügyletek, illetve azokon alapuló határidős tőzsdei ügyletek, tőzsdén kívüli határidős ügyletek és opciók, amelyek esetében a két fél azonos pénznemben denominált pénzforgalmat cserél, és ahol mindkét láb pénzforgalmát változó kamatláb határozza meg. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP vagy FONS vagy FWOS vagy OPTS RTS2#16 = FFSC	Az egydevizás változókamat-csereügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#13) – azon névleges pénznem, amelyben a csereügylet két lába denominált **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: 1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 1 hónap 2. lejárati csoport: 1 hónap < futamidő ≤ 3 hónap 3. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap 4. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év 5. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év 6. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év … m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
Egydevizás rögzítettkamat-csereügyletek, valamint egydevizás rögzítettkamat-csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek, tőzsdén kívüli határidős ügyletek, opciók Olyan csereügyletek, illetve azokon alapuló határidős tőzsdei ügyletek, tőzsdén kívüli határidős ügyletek és opciók, amelyek esetében a két fél azonos pénznemben denominált pénzforgalmat cserél, és ahol mindkét láb pénzforgalmát rögzített kamatláb határozza meg. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP vagy FONS vagy FWOS vagy OPTS RTS2#16 = XXSC	Az egydevizás rögzítettkamat-csereügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#13) – azon névleges pénznem, amelyben a csereügylet két lába denominált **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: 1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 1 hónap 2. lejárati csoport: 1 hónap < futamidő ≤ 3 hónap 3. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap 4. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év 5. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év 6. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év … m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
Egydevizás egynapos indexált csereügyletek (Overnight Index Swap, OIS), valamint egydevizás egynapos indexált csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek, tőzsdén kívüli határidős ügyletek, opciók Olyan csereügyletek, illetve azokon alapuló határidős tőzsdei ügyletek, tőzsdén kívüli határidős ügyletek és opciók amelyek esetében a két fél azonos pénznemben denominált pénzforgalmat cserél, és ahol legalább az egyik láb pénzforgalmát OIS kamatláb határozza meg. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP vagy FONS vagy FWOS vagy OPTS RTS2#16 = OSSC	Az egydevizás egynapos indexált csereügyletek (OIS) alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#13) – azon névleges pénznem, amelyben a csereügylet két lába denominált **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: 1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 1 hónap 2. lejárati csoport: 1 hónap < futamidő ≤ 3 hónap 3. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap 4. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év 5. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év 6. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év … m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Kiegészítő minőségi likviditási kritérium**
Egydevizás inflációs csereügyletek, valamint egydevizás inflációs csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek, tőzsdén kívüli határidős ügyletek, opciók Olyan csereügyletek, illetve azokon alapuló határidős tőzsdei ügylete, tőzsdén kívüli határidős ügyletek és opciók, amelyek esetében a két fél azonos pénznemben denominált pénzforgalmat cserél, és ahol legalább az egyik láb pénzforgalmát inflációs ráta határozza meg. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP vagy FONS vagy FWOS vagy OPTS RTS2#16 = IFSC	Az egydevizás inflációs csereügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#13) – azon névleges pénznem, amelyben a csereügylet két lába denominált **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: 1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 1 hónap 2. lejárati csoport: 1 hónap < futamidő ≤ 3 hónap 3. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap 4. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év 5. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év 6. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év … m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Eszközosztály – Származtatott kamatügyletek	
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében a következő módszertant kell alkalmazni**
Egyéb származtatott kamatügyletek A fenti eszköz-alosztályok egyikébe sem tartozó származtatott kamatügyletek. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = OTHR	Az egyéb származtatott kamatügyletek likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülnek.

▼M4

5.2. táblázat

Származtatott kamatügyletek – Likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek

Eszközosztály – Származtatott kamatügyletek									
Eszköz-alosztály	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő minden alkategória esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**								
	A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek	**Kereskedés előtti LIS**		**Kereskedés utáni SSTI**			**Kereskedés utáni LIS**		
		Kereskedés – percentilis	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**
Határidős tőzsdei kötvényügyletek és tőzsdén kívüli határidős kötvényügyletek	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	5 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
Kötvényopciók	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	5 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
Kamatalapú (IR) határidős tőzsdei ügyletek és határidős kamatláb-megállapodások (FRA)	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	10 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Származtatott kamatügyletek									
Eszköz-alosztály	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő minden alkategória esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**								
	A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek	**Kereskedés előtti LIS**		**Kereskedés utáni SSTI**			**Kereskedés utáni LIS**		
		Kereskedés – percentilis	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**
Kamatalapú opciók	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	10 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
Csereügyletre szóló opciók	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Eltérő pénznemű („multi-currency” vagy „cross-currency”) rögzített–változó kamatcsereügyletek, valamint eltérő pénznemű rögzített–változó kamatcsereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Származtatott kamatügyletek									
Eszköz-alosztály	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő minden alkategória esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**								
	A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek	**Kereskedés előtti LIS**		**Kereskedés utáni SSTI**			**Kereskedés utáni LIS**		
		Kereskedés – percentilis	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**
Eltérő pénznemű („multi-currency” vagy „cross-currency”) változókamat-csereügyletek, valamint eltérő pénznemű változókamat-csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Eltérő pénznemű („multi-currency” vagy „cross-currency”) rögzített-kamat-csereügyletek, valamint eltérő pénznemű rögzítettkamat-csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Származtatott kamatügyletek									
Eszköz-alosztály	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő minden alkategória esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**								
	A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek	**Kereskedés előtti LIS**		**Kereskedés utáni SSTI**			**Kereskedés utáni LIS**		
		Kereskedés – percentilis	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**
Eltérő pénznemű („multi-currency” vagy „cross-currency”) egynapos indexált csereügyletek (Overnight Index Swap, OIS), valamint eltérő pénznemű egynapos indexált csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Eltérő pénznemű („multi-currency” vagy „cross-currency”) inflációs csereügyletek, valamint eltérő pénznemű inflációs csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Azonos pénznemű („single currency”) rögzített–változó kamatcsereügyletek, valamint azonos pénznemű rögzített–változó kamatcsereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Származtatott kamatügyletek									
Eszköz-alosztály	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő minden alkategória esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**								
	A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek	**Kereskedés előtti LIS**		**Kereskedés utáni SSTI**			**Kereskedés utáni LIS**		
		Kereskedés – percentilis	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**
Azonos pénznemű („single currency”) változókamat-csereügyletek, valamint azonos pénznemű változókamat-csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Azonos pénznemű („single currency”) rögzítettkamat-csereügyletek, valamint azonos pénznemű rögzítettkamat-csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Azonos pénznemű („single currency”) egynapos indexált csereügyletek (Overnight Index Swap, OIS), valamint azonos pénznemű egynapos indexált csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Származtatott kamatügyletek									
Eszköz-alosztály	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő minden alkategória esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**								
	A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek	**Kereskedés előtti LIS**		**Kereskedés utáni SSTI**			**Kereskedés utáni LIS**		
		Kereskedés – percentilis	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**
Azonos pénznemű („single currency”) inflációs csereügyletek, valamint azonos pénznemű inflációs csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

5.3. táblázat

Származtatott kamatügyletek – Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek

Eszközosztály – Származtatott kamatügyletek			
Eszköz-alosztály	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő egyes alkategóriák esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**		
	Kereskedés előtti LIS	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
	Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Határidős tőzsdei kötvényügyletek és tőzsdén kívüli határidős kötvényügyletek	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Kötvényopciók	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Kamatalapú (IR) határidős tőzsdei ügyletek és határidős kamatláb-megállapodások (FRA)	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Származtatott kamatügyletek			
Eszköz-alosztály	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő egyes alkategóriák esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**		
	Kereskedés előtti LIS	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
	Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Kamatalapú opciók	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Csereügyletre szóló opciók	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Eltérő pénznemű („multi-currency” vagy „cross-currency”) rögzített–változó kamatcsereügyletek, valamint eltérő pénznemű rögzített–változó kamatcsereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Eltérő pénznemű („multi-currency” vagy „cross-currency”) változókamat-csereügyletek, valamint eltérő pénznemű változókamat-csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Eltérő pénznemű („multi-currency” vagy „cross-currency”) rögzítettkamat-csereügyletek, valamint eltérő pénznemű rögzítettkamat-csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Eltérő pénznemű („multi-currency” vagy „cross-currency”) egynapos indexált csereügyletek (Overnight Index Swap, OIS), valamint eltérő pénznemű egynapos indexált csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Eltérő pénznemű („multi-currency” vagy „cross-currency”) inflációs csereügyletek, valamint eltérő pénznemű inflációs csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Azonos pénznemű („single currency”) rögzített–változó kamatcsereügyletek, valamint azonos pénznemű rögzített–változó kamatcsereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Származtatott kamatügyletek			
Eszköz-alosztály	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő egyes alkategóriák esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**		
	Kereskedés előtti LIS	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
	Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Azonos pénznemű („single currency”) változókamat-csereügyletek, valamint azonos pénznemű változókamat-csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Azonos pénznemű („single currency”) rögzítettkamat-csereügyletek, valamint azonos pénznemű rögzítettkamat-csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Azonos pénznemű („single currency”) egynapos indexált csereügyletek (Overnight Index Swap, OIS), valamint azonos pénznemű egynapos indexált csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Azonos pénznemű („single currency”) inflációs csereügyletek, valamint azonos pénznemű inflációs csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Egyéb származtatott kamatügyletek	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR

▼B

6. **Származtatott részvényügyletek**

▼M3

6.1. táblázat

Származtatott részvényügyletek – Likvid piaccal nem rendelkező osztályok

Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek
A 2014/65/EU irányelv I. melléklete C. szakaszának 4. pontjában meghatározott, a következőkhöz kapcsolódó szerződés:
a) egy vagy több részvény, letéti igazolás, tőzsdén kereskedett alap, certifikát, egyéb hasonló pénzügyi eszköz vagy pénzforgalom, illetve egy vagy több részvény, letéti igazolás, tőzsdén kereskedett alap, certifikát, egyéb hasonló pénzügyi eszköz vagy pénzforgalom teljesítményéhez kötött más termék;
b) részvények, letéti igazolások, tőzsdén kereskedett alapok, certifikátok, egyéb hasonló pénzügyi eszközök vagy pénzforgalmak, illetve egy vagy több részvény, letéti igazolás, tőzsdén kereskedett alap, certifikát, egyéb hasonló pénzügyi eszköz vagy pénzforgalom teljesítményéhez kötött más termékek indexe.

▼M3

Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek	
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében a következő módszertant kell alkalmazni**
Részvényindex-opciók Részvényekből álló indexen alapuló opciós ügylet. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = STIX RTS23#26 vagy ha nulla, akkor RTS23#28	Minden indexopció likvid piaccal rendelkezőnek minősül.
Határidős tőzsdei részvényindex-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős részvényindex-ügyletek Részvényekből álló indexen alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR vagy FORW RTS2#27 = STIX RTS23#26 vagy ha nulla, akkor RTS23#28	Minden határidős tőzsdei részvényindex-ügylet és tőzsdén kívüli határidős részvényindex-ügylet likvid piaccal rendelkezőnek minősül.
Részvényopciók Vállalati intézkedéssel létrehozott részvényen vagy részvénykosáron alapuló opciós ügylet. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = SHRS RTS23#26 vagy ha nulla, akkor RTS23#28	Minden részvényopció likvid piaccal rendelkezőnek minősül.

▼M3

Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek	
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében a következő módszertant kell alkalmazni**
Határidős tőzsdei részvényügyletek és tőzsdén kívüli határidős részvényügyletek Vállalati intézkedéssel létrehozott részvényen vagy részvénykosáron alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR vagy FORW RTS2#27 = SHRS RTS23#26 vagy ha nulla, akkor RTS23#28	Minden határidős tőzsdei részvényügylet és tőzsdén kívüli határidős részvényügylet likvid piaccal rendelkezőnek minősül.
Részvényosztalék-opciók Egy adott részvény osztalékán alapuló opciós ügylet. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = DVSE RTS23#26 vagy ha nulla, akkor RTS23#28	Minden részvényosztalék-opció likvid piaccal rendelkezőnek minősül.
Határidős tőzsdei részvényosztalék-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős részvényosztalék-ügyletek Egy adott részvény osztalékán alapuló határidős tőzsdei ügylet és tőzsdén kívüli határidős ügylet. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR vagy FORW RTS2#27 = DVSE RTS23#26 vagy ha nulla, akkor RTS23#28	Minden határidős tőzsdei részvényosztalék-ügylet és tőzsdén kívüli határidős részvényosztalék-ügylet likvid piaccal rendelkezőnek minősül.

▼M3

Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek	
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében a következő módszertant kell alkalmazni**
Osztalékindex-opciók Több részvény osztalékaiból álló indexen alapuló opciós ügylet. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = DIVI RTS23#26 vagy ha nulla, akkor RTS23#28	Minden osztalékindex-opció likvid piaccal rendelkezőnek minősül.
Határidős tőzsdei osztalékindex-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős osztalékindex-ügyletek Több részvény osztalékaiból álló indexen alapuló határidős tőzsdei ügylet és tőzsdén kívüli határidős ügylet. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR vagy FORW RTS2#27 = DIVI RTS23#26 vagy ha nulla, akkor RTS23#28	Minden határidős tőzsdei osztalékindex-ügylet és tőzsdén kívüli határidős osztalékindex-ügylet likvid piaccal rendelkezőnek minősül.
Volatilitásindex-opciók Egy volatilitásindexen – azaz egy adott mögöttes tőkeinstrumentum-index volatilitását jelző indexen – alapuló opciós ügylet. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = VOLI RTS23#26 vagy ha nulla, akkor RTS23#28	Minden volatilitásindex-opció likvid piaccal rendelkezőnek minősül.

▼M3

Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek	
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében a következő módszertant kell alkalmazni**
Határidős tőzsdei volatilitásindex-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős volatilitásindex-ügyletek Egy volatilitásindexen – azaz egy adott mögöttes tőkeinstrumentum-index volatilitását jelző indexen – alapuló határidős tőzsdei ügylet és tőzsdén kívüli határidős ügylet. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR vagy FORW RTS2#27 = VOLI RTS23#26 vagy ha nulla, akkor RTS23#28	Minden határidős tőzsdei volatilitásindex-ügylet és tőzsdén kívüli határidős volatilitásindex-ügylet likvid piaccal rendelkezőnek minősül.
ETF-opciók Tőzsdén kereskedett alapon (ETF) alapuló opciós ügylet. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = ETFS RTS23#26 vagy ha nulla, akkor RTS23#28	Minden ETF-opció likvid piaccal rendelkezőnek minősül.
Határidős tőzsdei ETF-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ETF-ügyletek Tőzsdén kereskedett alapon (ETF) alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR vagy FORW RTS2#27 = ETFS RTS23#26 vagy ha nulla, akkor RTS23#28	Minden határidős tőzsdei ETF-ügylet és tőzsdén kívüli határidős ETF-ügylet likvid piaccal rendelkezőnek minősül.

▼M3

<table>
<tr><th colspan="4">Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Eszköz-alosztály</th><th rowspan="2" colspan="3">A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani</th><th colspan="2">Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének</th></tr>
<tr><th>Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]</th><th>Átlagos napi ügyletszám [2. mennyiségi likviditási kritérium]</th></tr>
<tr><td>Csereügyletek
RTS2#3 = DERV
RTS2#4 = EQUI
RTS2#5 = SWAP</td><td colspan="3">A csereügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni:
1. szegmentációs kritérium (RTS2#27)) – alaptermék típusa: egyedi alaptermék, index, kosár
2. szegmentációs kritérium (RTS23#26 vagy ha nulla, akkor RTS23#28) – mögöttes egyedi alaptermék, index, kosár
3. szegmentációs kritérium (RTS2#28)) – paraméter: árfolyamnyereség alapteljesítmény paraméter, osztalékhozam paraméter, hozamvariancia paraméter, hozamvolatilitás paraméter
4. szegmentációs kritérium (RTS2#8) – a csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint:
<table>
<tr><th>Árfolyamnyereség alapteljesítmény paraméter</th><th>Hozamvariancia/hozamvolatilitás paraméter</th><th>Osztalékhozam paraméter</th></tr>
<tr><td>1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 1 hónap</td><td>1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 3 hónap</td><td>1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 1 év</td></tr>
<tr><td>2. lejárati csoport: 1 hónap < futamidő ≤ 3 hónap</td><td>2. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap</td><td>2. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év</td></tr>
<tr><td>3. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap</td><td>3. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év</td><td>3. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év</td></tr>
<tr><td>4. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év</td><td>4. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év</td><td>…</td></tr>
</table></td><td>50 000 000 EUR</td><td></td></tr>
</table>

▼M3

Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek					
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**			**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének**	
				Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
	5. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év	**5. lejárati csoport**: 2 év < futamidő ≤ 3 év	**m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év		
	6. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év	…			
	…	**m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év			
	m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év				
Portfólió-csereügyletek RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = PSWP	A portfólió-csereügyletek alkategóriáit a következő tényezők sajátos kombinációja határozza meg: **1. szegmentációs kritérium** (RTS2#27)) – alaptermék típusa: egyedi alaptermék, index, kosár **2. szegmentációs kritérium** (RTS23#26 vagy ha nulla, akkor RTS23#28) – mögöttes egyedi alaptermék, index, kosár **3. szegmentációs kritérium** (RTS2#28)) – paraméter: árfolyamnyereség alapteljesítmény paraméter, osztalékhozam paraméter, hozamvariancia paraméter, hozamvolatilitás paraméter **4. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a portfólió-csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: **1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 1 hónap **2. lejárati csoport**: 1 < futamidő ≤ 3 hónap **3. lejárati csoport**: 3 hónap < futamidő ≤ 6 év **4. lejárati csoport**: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év **5. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év **6. lejárati csoport**: 2 év < futamidő ≤ 3 év … **m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év			50 000 000 EUR	15

▼M3

Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek	
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében a következő módszertant kell alkalmazni**
Egyéb származtatott részvényügyletek A fenti eszköz-alosztályok egyikébe sem tartozó származtatott részvény-ügyletek. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OTHR	Az egyéb származtatott részvényügyletek likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülnek.

▼M4

6.2. táblázat

Származtatott részvényügyletek – Likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek

Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek						
Eszköz-alosztály	**A kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöb-értékek meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek**	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriákra meghatározott kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek az alkategória átlagos napi névleges összeg (ADNA) sávja szerint**			
			Átlagos napi névleges összeg (ADNA)	**Kereskedés előtti LIS**	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
				Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Részvényindex-opciók	A részvényindex-opciók alkategóriáját a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** – alapul szolgáló részvényindex	a küszöbértékekre vonatkozó számításokat minden egyes alkategória tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	ADNA < 100 millió EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 millió EUR ≤ ADNA < 200 millió EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 millió EUR ≤ ADNA < 600 millió EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 millió EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek						
Eszköz-alosztály	**A kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek**	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriákra meghatározott kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek az alkategória átlagos napi névleges összeg (ADNA) sávja szerint**			
			Átlagos napi névleges összeg (ADNA)	**Kereskedés előtti LIS**	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
				Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Határidős tőzsdei részvényindex-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős részvényindex-ügyletek	a határidős tőzsdei részvényindex-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős részvényindex-ügyletek alkategóriáját a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium –** alapul szolgáló részvényindex	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat minden egyes alkategória tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	ADNA < 100 millió EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 millió EUR ≤ ADNA < 1 milliárd EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 milliárd EUR ≤ ADNA < 3 milliárd EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 milliárd EUR ≤ ADNA < 5 milliárd EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 milliárd EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Részvényopciók	a részvényopciók alkategóriáját a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium –** alaprészvény	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat minden egyes alkategória tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	ADNA < 5 millió EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 millió EUR ≤ ADNA < 10 millió EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 millió EUR ≤ ADNA < 20 millió EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 millió EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek						
Eszköz-alosztály	**A kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek**	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriákra meghatározott kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek az alkategória átlagos napi névleges összeg (ADNA) sávja szerint**			
			Átlagos napi névleges összeg (ADNA)	**Kereskedés előtti LIS**	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
				Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Határidős tőzsdei részvényügyletek és tőzsdén kívüli határidős részvényügyletek	a határidős tőzsdei részvényügyletek és tőzsdén kívüli határidős részvényügyletek alkategóriáját a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium –** alaprészvény	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat minden egyes alkategória tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	ADNA < 5 millió EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 millió EUR ≤ ADNA < 10 millió EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 millió EUR ≤ ADNA < 20 millió EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 millió EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
Részvényosztalék-opciók	A részvényosztalék-opciók alkategóriáját a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium –** osztalékra jogosító alaprészvény	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat minden egyes alkategória tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	ADNA < 5 millió EUR	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR
			5 millió EUR ≤ ADNA < 10 millió EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR
			10 millió EUR ≤ ADNA < 20 millió EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			ADNA ≥ 20 millió EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek						
Eszköz-alosztály	**A kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek**	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriákra meghatározott kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek az alkategória átlagos napi névleges összeg (ADNA) sávja szerint**			
			Átlagos napi névleges összeg (ADNA)	**Kereskedés előtti LIS**	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
				Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Határidős tőzsdei részvényosztalék-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős részvényosztalék-ügyletek	A határidős tőzsdei részvényosztalék-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős részvényosztalék-ügyletek alkategóriáját a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium –** osztalékra jogosító alaprészvény	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat minden egyes alkategória tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	ADNA < 5 millió EUR	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR
			5 millió EUR ≤ ADNA < 10 millió EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR
			10 millió EUR ≤ ADNA < 20 millió EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			ADNA ≥ 20 millió EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR
Osztalékindex-opciók	Az osztalékindex-opciók alkategóriáját a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium –** alapul szolgáló osztalékindex	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat minden egyes alkategória tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	ADNA < 100 millió EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 millió EUR ≤ ADNA < 200 millió EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 millió EUR ≤ ADNA < 600 millió EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 millió EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek						
Eszköz-alosztály	**A kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek**	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriákra meghatározott kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek az alkategória átlagos napi névleges összeg (ADNA) sávja szerint**			
			Átlagos napi névleges összeg (ADNA)	**Kereskedés előtti LIS**	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
				Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Határidős tőzsdei osztalékindex-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős osztalékindex-ügyletek	A határidős tőzsdei osztalékindex-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős osztalékindex-ügyletek alkategóriáját a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium –** alapul szolgáló osztalékindex	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat minden egyes alkategória tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	ADNA < 100 millió EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 millió EUR ≤ ADNA < 1 milliárd EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 milliárd EUR ≤ ADNA < 3 milliárd EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 milliárd EUR ≤ ADNA < 5 milliárd EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 milliárd EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Volatilitásindex-opciók	A volatilitásindex-opciók alkategóriáját a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium –** alapul szolgáló volatilitásindex	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat minden egyes alkategória tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	ADNA < 100 millió EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 millió EUR ≤ ADNA < 200 millió EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 millió EUR ≤ ADNA < 600 millió EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 millió EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek						
Eszköz-alosztály	**A kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek**	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriákra meghatározott kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek az alkategória átlagos napi névleges összeg (ADNA) sávja szerint**			
			Átlagos napi névleges összeg (ADNA)	**Kereskedés előtti LIS**	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
				Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Határidős tőzsdei volatilitásindex-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős volatilitásindex-ügyletek	A határidős tőzsdei volatilitásindex-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős volatilitásindex-ügyletek alkategóriáját a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium –** alapul szolgáló volatilitásindex	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat minden egyes alkategória tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	ADNA < 100 millió EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 millió EUR ≤ ADNA < 1 milliárd EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 milliárd EUR ≤ ADNA < 3 milliárd EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 milliárd EUR ≤ ADNA < 5 milliárd EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 milliárd EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
ETF-opciók	Az ETF-opciók alkategóriáját a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. Szegmentációs kritérium –** alapul szolgáló ETF	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat minden egyes alkategória tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	ADNA < 5 millió EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 millió EUR ≤ ADNA < 10 millió EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 millió EUR ≤ ADNA < 20 millió EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 millió EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek						
Eszköz-alosztály	**A kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek**	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriákra meghatározott kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek az alkategória átlagos napi névleges összeg (ADNA) sávja szerint**			
			Átlagos napi névleges összeg (ADNA)	**Kereskedés előtti LIS**	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
				Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Határidős tőzsdei ETF-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ETF-ügyletek	A határidős tőzsdei ETF-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ETF-ügyletek alkategóriáját a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. Szegmentációs kritérium –** alapul szolgáló ETF	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat minden egyes alkategória tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	ADNA < 5 millió EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 millió EUR ≤ ADNA < 10 millió EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 millió EUR ≤ ADNA < 20 millió EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 millió EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
Csereügyletek	A csereügyletek alkategóriáját a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium –** alaptermék típusa: egyedi alaptermék, index, kosár **2. szegmentációs kritérium** – mögöttes egyedi alaptermék, index, kosár **3. szegmentációs kritérium –** paraméter: árfolyamnyereség alapteljesítmény paraméter, osztalékhozam paraméter, hozamvariancia paraméter, hozamvolatilitás paraméter **4. szegmentációs kritérium** – a csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint:	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat minden egyes alkategória tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	50 millió EUR ≤ ADNA < 100 millió EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 millió EUR ≤ ADNA < 200 millió EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 200 millió EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek							
Eszköz-alosztály	**A kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**			**A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek**	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriákra meghatározott kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek az alkategória átlagos napi névleges összeg (ADNA) sávja szerint**		
					Átlagos napi névleges összeg (ADNA)	**Kereskedés előtti LIS**	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
						Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
	Árfolyamnyereség alapteljesítmény paraméter	Hozamvariancia/ hozamvolatilitás paraméter	Osztalékhozam paraméter					
	1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 1 hónap	**1. lejárati csoport:** 0 < futamidő ≤ 3 hónap	**1. lejárati csoport:** 0 < futamidő ≤ 1 év					
	2. lejárati csoport: 1 hónap < futamidő ≤ 3 hónap	**2. lejárati csoport:** 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap	**2. lejárati csoport:** 1 év < futamidő ≤ 2 év					
	3. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap	**3. lejárati csoport:** 6 hónap < futamidő ≤ 1 év	**3. lejárati csoport:** 2 év < futamidő ≤ 3 év					
	4. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év	**4. lejárati csoport:** 1 év < futamidő ≤ 2 év	…					

▼M4

Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek								
Eszköz-alosztály	**A kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**			**A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek**	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriákra meghatározott kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek az alkategória átlagos napi névleges összeg (ADNA) sávja szerint**			
					Átlagos napi névleges összeg (ADNA)	**Kereskedés előtti LIS**	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
						Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
	5. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év	**5. lejárati csoport:** 2 év < futamidő ≤ 3 év	***m*. lejárati csoport:** (*n*–1) év < futamidő ≤ *n* év					
	6. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év	…						
	…	***m*. lejárati csoport:** (*n*–1) év < futamidő ≤ *n* év						
	***m*. lejárati csoport:** (*n*–1) év < futamidő ≤ *n* év							
Portfólió-csereügyletek	A portfólió-csereügyletet a következő tényezők sajátos kombinációja határozza meg: **1. szegmentációs kritérium –** alaptermék típusa: egyedi alaptermék, index, kosár **2. szegmentációs kritérium** – mögöttes egyedi alaptermék, index, kosár **3. szegmentációs kritérium –** paraméter: árfolyamnyereség alapteljesítmény paraméter, osztalékhozam paraméter, hozamvariancia paraméter, hozamvolatilitás paraméter **4. szegmentációs kritérium** – a portfólió-csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint:			A küszöbértékekre vonatkozó számításokat minden egyes alkategória tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	50 millió EUR ≤ ADNA < 100 millió EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
					100 millió EUR ≤ ADNA < 200 millió EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
					ADNA ≥ 200 millió EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek						
Eszköz-alosztály	**A kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek**	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriákra meghatározott kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek az alkategória átlagos napi névleges összeg (ADNA) sávja szerint**			
			Átlagos napi névleges összeg (ADNA)	**Kereskedés előtti LIS**	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
				Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
	1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 1 hónap **2. lejárati csoport:** 1 hónap < futamidő ≤ 3 hónap **3. lejárati csoport:** 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap **4. lejárati csoport:** 6 hónap < futamidő ≤ 1 év **5. lejárati csoport:** 1 év < futamidő ≤ 2 év **6. lejárati csoport:** 2 év < futamidő ≤ 3 év … ***m*. lejárati csoport:** (*n*–1) év < futamidő ≤ *n* év					

6.3. táblázat

Származtatott részvényügyletek – Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek

Eszközosztály – Származtatott részvényügyletek			
Eszköz-alosztály	**Az egyes, likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek**		
	Kereskedés előtti LIS	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
	Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Csereügyletek	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR
Portfólió-csereügyletek	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR
Egyéb származtatott részvényügyletek	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR

▼B

7. **Származtatott áruügyletek**

▼M3

7.1. táblázat

Származtatott áruügyletek – Likvid piaccal nem rendelkező osztályok

<table>
<tr><td colspan="4">Eszközosztály – Származtatott áruügyletek</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Eszköz-alosztály</td><td rowspan="2">A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani</td><td colspan="2">Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének</td></tr>
<tr><td>Átlagos napi névleges összeg (ADNA)
[1. mennyiségi likviditási kritérium]</td><td>Átlagos napi ügyletszám
[2. mennyiségi likviditási kritérium]</td></tr>
<tr><td>Határidős tőzsdei fémáruügyletek és tőzsdén kívüli határidős fémáruügyletek
RTS2#3 = DERV és RTS2#4 = COMM és RTS23#35 = METL és [RTS2#5 = FUTR vagy FORW]</td><td>A határidős tőzsdei fémáruügyletek és tőzsdén kívüli határidős fémáruügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni:
1. szegmentációs kritérium (RTS23#36) – fém típusa: nemesfém, nem nemesfém
2. szegmentációs kritérium (RTS23#37) – alapul szolgáló fém
3. szegmentációs kritérium (RTS2#15) – névleges pénznem, azaz azon pénznem, amelyben a határidős tőzsdei ügylet / tőzsdén kívüli határidős ügylet névleges értéke denominált
4. szegmentációs kritérium (RTS2#8) – a határidős tőzsdei ügylet / tőzsdén kívüli határidős ügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint:
<table>
<tr><th>Nemesfémek</th><th>Nem nemesfémek</th></tr>
<tr><td>1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 3 hónap</td><td>1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 1 év</td></tr>
<tr><td>2. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 1 év</td><td>2. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év</td></tr>
<tr><td>3. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év</td><td>3. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év</td></tr>
</table></td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
</table>

▼M3

Eszközosztály – Származtatott áruügyletek				
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**		**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének**	
			Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
	4. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év	…		
	…	**m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év		
	m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év			
Fémáru-opciók RTS2#3 = DERV és RTS2#4 = COMM és RTS23#35 = METL és RTS2#5 = OPTN	A fémáru-opciók alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#36) – fém típusa: nemesfém, nem nemesfém **2. szegmentációs kritérium** (RTS23#37) – alapul szolgáló fém **3. szegmentációs kritérium** (RTS2#15) – névleges pénznem, azaz azon pénznem, amelyben az opciós ügylet névleges értéke denominált **4. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – az opció lejárati csoportja a következő meghatározás szerint:		10 000 000 EUR	10
	Nemesfémek	**Nem nemesfémek**		
	1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 3 hónap	**1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 1 év		
	2. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 1 év	**2. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év		

▼M3

Eszközosztály – Származtatott áruügyletek				
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**		**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének**	
			Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
	3. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év	**3. lejárati csoport**: 2 év < futamidő ≤ 3 év		
	4. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év	…		
	…	**m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év		
	m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év			
Fémáru-csereügyletek RTS2#3 = DERV és RTS2#4 = COMM és RTS23#35 = METL és RTS2#5 = SWAP	A fémáru-csereügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#36) – fém típusa: nemesfém, nem nemesfém **2. szegmentációs kritérium** (RTS23#37) – alapul szolgáló fém **3. szegmentációs kritérium** (RTS2#15) – névleges pénznem, azaz azon pénznem, amelyben a csereügylet névleges értéke denominált **4. szegmentációs kritérium** (RTS23#34) – ügylet kiegyenlítésének típusa: készpénz, fizikai vagy választható **5. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint:		10 000 000 EUR	10
	Nemesfémek	**Nem nemesfémek**		
	1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 3 hónap	**1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 1 év		

▼M3

Eszközosztály – Származtatott áruügyletek				
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**		**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének**	
			Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
	2. lejárati csoport: 3 hónap < futamidő ≤ 1 év	**2. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év		
	3. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év	**3. lejárati csoport**: 2 év < futamidő ≤ 3 év		
	4. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év	…		
	…	**m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év		
	m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év			
Határidős tőzsdei energiaügyletek és tőzsdén kívüli határidős energiaügyletek RTS2#3 = DERV és RTS2#4 = COMM és RTS23#35 = NRGY és [RTS2#5 = FUTR vagy FORW]	A határidős tőzsdei energiaügyletek és tőzsdén kívüli határidős energiaügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#36)) – energia típusa: olaj, olajpárlat, szén, könnyű olaj-előpárlat, földgáz, villamos energia, energiaközi termék **2. szegmentációs kritérium** (RTS23#37) – alapul szolgáló energia **3. szegmentációs kritérium** (RTS2#15) – névleges pénznem, azaz azon pénznem, amelyben a határidős tőzsdei ügylet / tőzsdén kívüli határidős ügylet névleges értéke denominált **4. szegmentációs kritérium** – [törölve]		10 000 000 EUR	10

▼M3

<table>
<tr><td colspan="5">Eszközosztály – Származtatott áruügyletek</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Eszköz-alosztály</td><td colspan="3" rowspan="2">A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani</td><td colspan="2">Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének</td></tr>
<tr><td>Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]</td><td>Átlagos napi ügyletszám [2. mennyiségi likviditási kritérium]</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="3">5. szegmentációs kritérium (RTS2#14) – szállítás, illetve készpénzes kiegyenlítés helye minden energiatípus esetében
6. szegmentációs kritérium (RTS2#8) – a határidős tőzsdei ügylet / tőzsdén kívüli határidős ügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint:</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Olaj, olajpárlat, könnyű olaj-előpárlat</td><td>Szén</td><td>Földgáz, villamos energia, energiaközi termék</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 4 hónap</td><td>1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 6 hónap</td><td>1. lejárati csoport: 0 < futamidő ≤ 1 hónap</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>2. lejárati csoport: 4 hónap < futamidő ≤ 8 hónap</td><td>2. lejárati csoport: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év</td><td>2. lejárati csoport: 1 hónap < futamidő ≤ 1 év</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>3. lejárati csoport: 8 hónap < futamidő ≤ 1 év</td><td>3. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év</td><td>3. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>4. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év</td><td>…</td><td>…</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>…</td><td>m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év</td><td>m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év</td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

<table>
<tr><th colspan="5">Eszközosztály – Származtatott áruügyletek</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Eszköz-alosztály</th><th colspan="3" rowspan="2">A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani</th><th colspan="2">Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének</th></tr>
<tr><th>Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]</th><th>Átlagos napi ügyletszám [2. mennyiségi likviditási kritérium]</th></tr>
<tr><td>Energiatermék-opciók
RTS2#3 = DERV és RTS2#4 = COMM és RTS23#35 = NRGY és RTS2#5 = OPTN</td><td colspan="3">Az energiatermék-opciók alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni:
1. szegmentációs kritérium (RTS23#36)) – energia típusa: olaj, olajpárlat, szén, könnyű olaj-előpárlat, földgáz, villamos energia, energiaközi termék
2. szegmentációs kritérium (RTS23#37) – alapul szolgáló energia
3. szegmentációs kritérium (RTS2#15) – névleges pénznem, azaz azon pénznem, amelyben az opciós ügylet névleges értéke denominált
4. szegmentációs kritérium – [törölve]
5. szegmentációs kritérium (RTS2#14) – szállítás, illetve készpénzes kiegyenlítés helye minden energiatípus esetében
6. szegmentációs kritérium (RTS2#8) – az opció lejárati csoportja a következő meghatározás szerint:</td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
<tr><td></td><td>Olaj, olajpárlat, könnyű olaj-előpárlat</td><td>Szén</td><td>Földgáz, villamos energia, energiaközi termék</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>1. lejárati csoport:
0 < futamidő ≤ 4 hónap</td><td>1. lejárati csoport:
0 < futamidő ≤ 6 hónap</td><td>1. lejárati csoport:
0 < futamidő ≤ 1 hónap</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>2. lejárati csoport:
4 hónap < futamidő ≤ 8 hónap</td><td>2. lejárati csoport:
6 hónap < futamidő ≤ 1 év</td><td>2. lejárati csoport:
1 hónap < futamidő ≤ 1 év</td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

Eszközosztály – Származtatott áruügyletek					
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**			**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének**	
				Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
	3. lejárati csoport: 8 hónap < futamidő ≤ 1 év	**3. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év	**3. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év		
	4. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év	…	…		
	…	**m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év	**m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év		
	m. lejárati csoport: (n–1) év < futamidő ≤ n év				
Energiatermék-csereügyletek RTS2#3 = DERV és RTS2#4 = COMM és RTS23#35 = NRGY és RTS2#5 = SWAP	Az energiatermék-csereügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#36)) – energia típusa: olaj, olajpárlat, szén, könnyű olaj-előpárlat, földgáz, villamos energia, energiaközi termék **2. szegmentációs kritérium** (RTS23#37) – alapul szolgáló energia **3. szegmentációs kritérium** (RTS2#15) – névleges pénznem, azaz azon pénznem, amelyben a csereügylet névleges értéke denominált **4. szegmentációs kritérium** (RTS23#34) – ügylet kiegyenlítésének típusa: készpénz, fizikai vagy választható **5. szegmentációs kritérium** – [törölve] **6. szegmentációs kritérium** (RTS2#14) – szállítás, illetve készpénzes kiegyenlítés helye minden energiatípus esetében **7. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint:			10 000 000 EUR	10

▼M3

<table>
<tr><td colspan="5">Eszközosztály – Származtatott áruügyletek</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Eszköz-alosztály</td><td colspan="3" rowspan="2">A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani</td><td colspan="2">Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének</td></tr>
<tr><td>Átlagos napi névleges összeg (ADNA)
[1. mennyiségi likviditási kritérium]</td><td>Átlagos napi ügyletszám
[2. mennyiségi likviditási kritérium]</td></tr>
<tr><td rowspan="7"></td><td>Olaj, olajpárlat, könnyű olaj-előpárlat</td><td>Szén</td><td>Földgáz, villamos energia, energiaközi termék</td><td rowspan="7"></td><td rowspan="7"></td></tr>
<tr><td>1. lejárati csoport:
30 < futamidő ≤ 4 hónap</td><td>1. lejárati csoport:
0 < futamidő ≤ 6 hónap</td><td>1. lejárati csoport:
0 < futamidő ≤ 1 hónap</td></tr>
<tr><td>2. lejárati csoport:
4 hónap < futamidő ≤ 8 hónap</td><td>2. lejárati csoport:
6 hónap < futamidő ≤ 1 év</td><td>2. lejárati csoport:
1 hónap < futamidő ≤ 1 év</td></tr>
<tr><td>3. lejárati csoport: 8 hónap < futamidő ≤ 1 év</td><td>3. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év</td><td>3. lejárati csoport: 1 év < futamidő ≤ 2 év</td></tr>
<tr><td>4. lejárati csoport:
1 év < futamidő ≤ 2 év</td><td>…</td><td>…</td></tr>
<tr><td>…</td><td>m. lejárati csoport:
(n–1) év < futamidő ≤ n év</td><td>m. lejárati csoport:
(n–1) év < futamidő ≤ n év</td></tr>
<tr><td>m. lejárati csoport:
(n–1) év < futamidő ≤ n év</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>Határidős tőzsdei mezőgazdaságitermék-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős mezőgazdaságitermék-ügyletek
RTS2#3 = DERV és RTS2#4 = COMM és RTS23#35 = AGRI és [RTS2#5 = FUTR vagy FORW]</td><td colspan="3">A határidős tőzsdei mezőgazdaságitermék-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős mezőgazdaságitermék-ügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni:
1. szegmentációs kritérium (RTS23#36 és RTS23#37) — alapul szolgáló mezőgazdasági termék (alásorolt termék és további alásorolt termék)
2. szegmentációs kritérium (RTS2#15) – névleges pénznem, azaz azon pénznem, amelyben a határidős tőzsdei ügylet / tőzsdén kívüli határidős ügylet névleges értéke denominált</td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
</table>

▼M3

Eszközosztály – Származtatott áruügyletek			
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének**	
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
	3. szegmentációs kritérium (RTS2#8) – a határidős tőzsdei ügylet / tőzsdén kívüli határidős ügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: **1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 3 hónap **2. lejárati csoport**: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap **3. lejárati csoport**: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év **4. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év … **m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év		
Mezőgazdaságitermék-opciók RTS2#3 = DERV és RTS2#4 = COMM és RTS23#35 = AGRI és RTS2#5 = OPTN	A mezőgazdaságitermék-opciók alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#36 és RTS23#37) — alapul szolgáló mezőgazdasági termék (alásorolt termék és további alásorolt termék) **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#15) – névleges pénznem, azaz azon pénznem, amelyben az opciós ügylet névleges értéke denominált **3. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – az opció lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: **1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 3 hónap **2. lejárati csoport**: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap **3. lejárati csoport**: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év **4. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év … **m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év	10 000 000 EUR	10

▼M3

Eszközosztály – Származtatott áruügyletek			
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének**	
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
Mezőgazdaságitermék-csereügyletek RTS2#3 = DERV és RTS2#4 = COMM és RTS23#35 = AGRI és RTS2#5 = SWAP	A mezőgazdaságitermék-csereügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#36 és RTS23#37) — alapul szolgáló mezőgazdasági termék (alásorolt termék és további alásorolt termék) **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#15) – névleges pénznem, azaz azon pénznem, amelyben a csereügylet névleges értéke denominált **3. szegmentációs kritérium** (RTS23#34) – ügylet kiegyenlítésének típusa: készpénz, fizikai vagy választható **4. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: **1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 3 hónap **2. lejárati csoport**: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap **3. lejárati csoport**: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év **4. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év … **m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év	10 000 000 EUR	10
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében a következő módszertant kell alkalmazni**		
Egyéb származtatott áruügyletek A fenti eszköz-alosztályok egyikébe sem tartozó származtatott áruügyletek.	Az egyéb származtatott áruügyletek likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülnek.		

▼M4

7.2. táblázat

Származtatott áruügyletek – Likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek

Eszközosztály – Származtatott áruügyletek									
Eszköz-alosztály	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**								
	A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek	**Kereskedés előtti LIS**		**Kereskedés utáni SSTI**			**Kereskedés utáni LIS**		
		Kereskedés – percentilis	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**
Határidős tőzsdei fémáru-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős fémáruügyletek	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Fémáru-opciók	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Fémáru-csereügyletek	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Származtatott áruügyletek									
Eszköz-alosztály	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**								
	A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek	**Kereskedés előtti LIS**		**Kereskedés utáni SSTI**			**Kereskedés utáni LIS**		
		Kereskedés – percentilis	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**
Határidős tőzsdei energiaügyletek és tőzsdén kívüli határidős energiaügyletek	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Energiatermék-opciók	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Energiatermék-csereügyletek	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Származtatott áruügyletek									
Eszköz-alosztály	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**								
	A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek	**Kereskedés előtti LIS**		**Kereskedés utáni SSTI**			**Kereskedés utáni LIS**		
		Kereskedés – percentilis	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**
Határidős tőzsdei mezőgazdaságitermék-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős mezőgazdaságitermék-ügyletek	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Mezőgazdaságitermék-opciók	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Mezőgazdaságitermék-csereügyletek	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

▼M4

7.3. táblázat

Származtatott áruügyletek – Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek

Eszközosztály – Származtatott áruügyletek			
Eszköz-alosztály	**Az egyes, likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek**		
	Kereskedés előtti LIS	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
	Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Határidős tőzsdei fémáruügyletek és tőzsdén kívüli határidős fémáruügyletek	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Fémáru-opciók	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Fémáru-csereügyletek	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Határidős tőzsdei energiaügyletek és tőzsdén kívüli határidős energiaügyletek	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Energiatermék-opciók	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Energiatermék-csereügyletek	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Határidős tőzsdei mezőgazdaságitermék-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős mezőgazdaságitermék-ügyletek	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Mezőgazdaságitermék-opciók	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Mezőgazdaságitermék-csereügyletek	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Egyéb származtatott áruügyletek	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR

▼B

8. **Származtatott devizaügyletek**

▼M3

8.1. táblázat

Származtatott devizaügyletek – Likvid piaccal nem rendelkező osztályok

Eszközosztály – Származtatott devizaügyletek			
A 2014/65/EU irányelv I. melléklete C. szakaszának 4. pontjában meghatározott, devizákhoz kapcsolódó pénzügyi eszköz.			
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyi-eszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének**	
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
Nem leszállításos tőzsdén kívüli határidős ügyletek (NDF) Olyan tőzsdén kívüli határidős ügylet, amelyet a szerződési feltételek értelmében a partnerek készpénzben számolnak el, és ahol a kiegyenlítés összegét két pénznem átváltási árfolyamának a kötési időpont és az értékelés napja közötti különbözete határozza meg. A kiegyenlítés napján az egyik fél a névleges összeg alapján i. a kötési időpontban meghatározott átváltási árfolyam, valamint ii. az értékelés napján meghatározott átváltási árfolyam közötti nettó különbözettel tartozik a másik félnek, amely nettó összeget a szerződésben meghatározott elszámolási pénznemben kell megfizetnie. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FORW RTS2#26 = NDLV	A nem leszállításos tőzsdén kívüli határidős devizaügyletek (FX -ügyletek) alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#13 és RTS23#47) – alapul szolgáló devizapár, azaz a származtatott ügylet alapjául szolgáló két pénznem kombinációja **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a tőzsdén kívüli határidős ügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: **1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 1 hét **2. lejárati csoport**: 1 hét < futamidő ≤ 3 hónap **3. lejárati csoport**: 3 hónap < futamidő ≤ 1 év **4. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év **5. lejárati csoport**: 2 év < futamidő ≤ 3 év … **m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év	Minden nem leszállításos tőzsdén kívüli határidős ügylet (NDF) likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül.	

▼M3

Eszközosztály – Származtatott devizaügyletek			
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyi-eszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének**	
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
Leszállításos tőzsdén kívüli határidős ügyletek (DF) olyan tőzsdén kívüli határidős ügylet, amely kizárólag két különböző pénznemnek egy szerződésben meghatározott jövőbeni elszámolási időpontban, a cserére irányadó szerződés aláírásakor kikötött rögzített árfolyamon történő cseréjét foglalja magában. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FORW RTS2#26 = DLVB	A leszállításos tőzsdén kívüli határidős devizaügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#13 és RTS23#47) – alapul szolgáló devizapár, azaz a származtatott ügylet alapjául szolgáló két pénznem kombinációja **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a tőzsdén kívüli határidős ügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: **1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 1 hét **2. lejárati csoport**: 1 hét < futamidő ≤ 3 hónap **3. lejárati csoport**: 3 hónap < futamidő ≤ 1 év **4. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év **5. lejárati csoport**: 2 év < futamidő ≤ 3 év … **m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év	Minden leszállításos tőzsdén kívüli határidős ügylet (DF) likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül.	

▼M3

Eszközosztály – Származtatott devizaügyletek			
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyi-eszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének**	
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
Nem leszállításos opciós devizaügyletek (Non-Deliverable FX options, NDO) Olyan opciós ügylet, amelyet a szerződési feltételek értelmében a partnerek készpénzben számolnak el, és ahol a kiegyenlítés összegét két pénznem átváltási árfolyamának a kötési időpont és az értékelés napja közötti különbözete határozza meg. A kiegyenlítés napján az egyik fél a névleges összeg alapján i. a kötési időpontban meghatározott átváltási árfolyam, valamint ii. az értékelés napján meghatározott átváltási árfolyam közötti nettó különbözettel tartozik a másik félnek, amely nettó összeget a szerződésben meghatározott elszámolási pénznemben kell megfizetnie. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = OPTN RTS2#26 = NDLV	A nem leszállításos opciós devizaügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#13 and RTS23#47) – alapul szolgáló devizapár, azaz a származtatott ügylet alapjául szolgáló két pénznem kombinációja **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – az opció lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: **1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 1 hét **2. lejárati csoport**: 1 hét < futamidő ≤ 3 hónap **3. lejárati csoport**: 3 hónap < futamidő ≤ 1 év **4. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év **5. lejárati csoport**: 2 év < futamidő ≤ 3 év … **m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év	Minden nem leszállításos opciós devizaügylet (NDO) likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül.	

▼M3

Eszközosztály – Származtatott devizaügyletek			
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyi-eszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének**	
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
Leszállításos opciós devizaügyletek (DO) olyan opciós ügylet, amely kizárólag két különböző pénznemnek egy szerződésben meghatározott jövőbeni elszámolási időpontban, a cserére irányadó szerződés aláírásakor kikötött rögzített árfolyamon történő cseréjét foglalja magában. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = OPTN RTS2#26 = DLVB	A leszállításos opciós devizaügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#13 és RTS23#47) – alapul szolgáló devizapár, azaz a származtatott ügylet alapjául szolgáló két pénznem kombinációja **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – az opció lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: **1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 1 hét **2. lejárati csoport**: 1 hét < futamidő ≤ 3 hónap **3. lejárati csoport**: 3 hónap < futamidő ≤ 1 év **4. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év **5. lejárati csoport**: 2 év < futamidő ≤ 3 év … **m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év	Minden leszállításos opciós devizaügylet (DO) likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül.	

▼M3

Eszközosztály – Származtatott devizaügyletek			
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyi-eszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének**	
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
Nem leszállításos deviza-csereügyletek (Non-Deliverable FX swaps, NDS) Olyan csereügylet, amelyet a szerződési feltételek értelmében a partnerek készpénzben számolnak el, és ahol a kiegyenlítés összegét két pénznem átváltási árfolyamának a kötési időpont és az értékelés napja közötti különbözete határozza meg. A kiegyenlítés napján az egyik fél a névleges összeg alapján i. a kötési időpontban meghatározott átváltási árfolyam, valamint ii. az értékelés napján meghatározott átváltási árfolyam közötti nettó különbözettel tartozik a másik félnek, amely nettó összeget a szerződésben meghatározott elszámolási pénznemben kell megfizetnie. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = SWAP RTS2#26 = NDLV	A nem leszállításos deviza-csereügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#13 és RTS23#47) – alapul szolgáló devizapár, azaz a származtatott ügylet alapjául szolgáló két pénznem kombinációja **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: **1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 1 hét **2. lejárati csoport**: 1 hét < futamidő ≤ 3 hónap **3. lejárati csoport**: 3 hónap < futamidő ≤ 1 év **4. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év **5. lejárati csoport**: 2 év < futamidő ≤ 3 év … **m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év	Minden nem leszállításos deviza-csereügylet (NDS) likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül.	

▼M3

Eszközosztály – Származtatott devizaügyletek			
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyi-eszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének**	
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
Leszállításos deviza-csereügyletek (Deliverable FX swaps, DS) olyan csereügylet, amely kizárólag két különböző pénznemnek egy szerződésben meghatározott jövőbeni elszámolási időpontban, a cserére irányadó szerződés aláírásakor kikötött rögzített árfolyamon történő cseréjét foglalja magában. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = SWAP RTS2#26 = DLVB	A leszállításos deviza-csereügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#13 és RTS23#47) – alapul szolgáló devizapár, azaz a származtatott ügylet alapjául szolgáló két pénznem kombinációja **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a csereügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: **1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 1 hét **2. lejárati csoport**: 1 hét < futamidő ≤ 3 hónap **3. lejárati csoport**: 3 hónap < futamidő ≤ 1 év **4. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év **5. lejárati csoport**: 2 év < futamidő ≤ 3 év … **m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év	Minden leszállításos deviza-csereügylet (DS) likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül.	

▼M3

Eszközosztály – Származtatott devizaügyletek			
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyi-eszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének**	
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
Határidős tőzsdei devizaügyletek (FX futures) **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = FUTR	A határidős tőzsdei devizaügyletek és tőzsdén kívüli határidős kötvényügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#13 és RTS23#47) – alapul szolgáló devizapár, azaz a származtatott ügylet alapjául szolgáló két pénznem kombinációja **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a határidős ügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: **1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 1 hét **2. lejárati csoport**: 1 hét < futamidő ≤ 3 hónap **3. lejárati csoport**: 3 hónap < futamidő ≤ 1 év **4. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év **5. lejárati csoport**: 2 év < futamidő ≤ 3 év … **m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év	Minden határidős tőzsdei devizaügylet likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül.	

Eszközosztály – Származtatott devizaügyletek	
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében a következő módszertant kell alkalmazni**
Egyéb származtatott devizaügyletek A fenti eszköz-alosztályok egyikébe sem tartozó származtatott devizaügyletek. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = OTHR	Az egyéb származtatott devizaügyletek likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülnek.

▼M4

8.2. táblázat

Származtatott devizaügyletek – Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek

Eszközosztály – Származtatott devizaügyletek			
Eszköz-alosztály	**Az egyes, likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek**		
	Kereskedés előtti LIS	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
	Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Nem leszállításos tőzsdén kívüli határidős ügyletek (NDF)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Leszállításos tőzsdén kívüli határidős ügyletek (DF)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Nem leszállításos opciós devizaügyletek (Non-Deliverable FX options, NDO)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Leszállításos opciós devizaügyletek (Deliverable FX options, DO)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Nem leszállításos deviza-csereügyletek (Non-Deliverable FX swaps, NDS)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Leszállításos deviza-csereügyletek (Deliverable FX swaps, DS)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Határidős tőzsdei devizaügyletek (FX futures)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Egyéb származtatott devizaügyletek	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR

▼B

9. **Származtatott hitelügyletek**

▼M3

9.1. táblázat

Származtatott hitelügyletek – Likvid piaccal nem rendelkező osztályok

Eszközosztály – Származtatott hitelügyletek				
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.**		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Az index „on the run” státusa** [Kiegészítő minőségi likviditási kritérium]
Indexhez kötött hitelnemteljesítési csereügyletek (CDS) Olyan csereügylet, amely esetében a pénzforgalomcsere egy indexet alkotó több pénzügyi eszköz kibocsátóinak hitelképességéhez és hitelkockázati események bekövetkezéséhez kötött. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	Az indexhez kötött hitel-nemteljesítési csereügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS2#34) – alapul szolgáló index **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#42) – névleges pénznem, azaz azon pénznem, amelyben a származtatott ügylet névleges értéke denominált **3. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a CDS lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: **1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 1 év **2. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év **3. lejárati csoport**: 2 év < futamidő ≤ 3 év … **m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év	200 000 000 EUR	10	A mögöttes index likvid piaccal rendelkezőnek minősül: (1) mindaddig, amíg „on the run” státusban van; (2) első „off the run” státusának első 30 napja során. Az index „on the run” státusa az index mindenkori legfrissebb verzióját (sorozatát) jelöli, és az adott összeállítású index érvénybe lépésének napjától az index következő verziójának (sorozatának) érvénybe lépését megelőző napig tart. Az „első 'off the run' státus” az index azon verziójának (sorozatának) a státusát jelenti, amely egy adott időpontban közvetlenül megelőzi az aktuális „on-the run” verziót (sorozatot). A verzió (sorozat) az index következő verziójának (sorozatának) összeállításakor elveszíti „on-the run” státusát, és első „off the run” státusba kerül.

▼M3

Eszközosztály – Származtatott hitelügyletek				
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.**		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Az index „on the run” státusa** [Kiegészítő minőségi likviditási kritérium]
Egy alaptermékes (single name) hitelnemteljesítési csereügyletek (CDS) Olyan csereügylet, amely esetében a pénzforgalomcsere egyetlen pénzügyieszköz-kibocsátó hitelképességéhez és hitelkockázati események bekövetkezéséhez kötött. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	Az egy alaptermékes hitel-nemteljesítési csereügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS2#41) – alapul szolgáló alaptermék-kibocsátó **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#39) – az alapul szolgáló alaptermék-kibocsátó típusa a következő meghatározás szerint: „Állami vagy nyilvános típusú kibocsátó” az alábbi kategóriák egyikébe tartozó kibocsátó: (a) az Európai Unió; (b) valamely tagállam, ideértve annak kormányzati szervét, ügynökségét vagy különleges célú gazdasági egységét; (c) az a) és b) pontban fel nem sorolt állami szervezeti egység; (d) a szövetségi államformával rendelkező tagállamok esetében a szövetség tagjai; (e) több tagállam közös, különleges célú gazdasági egysége; (f) két vagy több tagállam által finanszírozás mobilizálása, valamint súlyos finanszírozási problémákkal küzdő vagy finanszírozási szempontból veszélyeztetett tagjai számára pénzügyi segítségnyújtás céljából alapított nemzetközi pénzügyi intézmény;	10 000 000 EUR	10	

▼M3

Eszközosztály – Származtatott hitelügyletek				
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.**		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Az index „on the run” státusa** [Kiegészítő minőségi likviditási kritérium]
	(g) az Európai Beruházási Bank; (h) az a)–c) pontban meghatározott állampapír-kibocsátónak nem minősülő közigazgatási intézmény. „Vállalati típusú kibocsátó” minden állami vagy nyilvános típusú kibocsátónak nem minősülő kibocsátó. **3. szegmentációs kritérium** (RTS2#42) – névleges pénznem, azaz azon pénznem, amelyben a származtatott ügylet névleges értéke denominált **4. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a CDS lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: **1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 1 év **2. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év **3. lejárati csoport**: 2 év < futamidő ≤ 3 év … **m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év			
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a következő minőségi likviditási kritériumoknak**		
CDS-index opciók CDS-indexen alapuló opciós ügylet.	A CDS-index opciók alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni:	Azok a 0–6 hónapos lejárati csoportba tartozó CDS-index opciók, amelyek mögöttes CDS-indexe likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriába tartozik, likvid piaccal rendelkezőnek minősülnek.		

▼M3

Eszközosztály – Származtatott hitelügyletek				
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.**		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Az index „on the run” státusa** [Kiegészítő minőségi likviditási kritérium]
RTS2#3 = DERV **RTS2#4 = CRDT**	**1. szegmentációs kritérium** (RTS23#26) – a CDS-indexnek az indexhez kötött hitel-nemteljesítési csereügyletek (CDS) eszköz-alosztálya tekintetében meghatározott alkategóriája **2. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – az opció lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: **1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 6 hónap **2. lejárati csoport**: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év **3. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év **4. lejárati csoport**: 2 év < futamidő ≤ 3 év … **m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év	Azok a nem a 0–6 hónapos lejárati csoportba tartozó CDS-index opciók, amelyek mögöttes CDS-indexe likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriába tartozik, likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülnek. Azok a CDS-index opciók, amelyek mögöttes CDS-indexe likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő alkategóriába tartozik, egyetlen lejárati csoport esetében sem minősülnek likvid piaccal rendelkezőnek.		
Egy alaptermékes (single name) CDS-opciók Egy alaptermékes CDS-en alapuló opciós ügyletek. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	Az egy alaptermékes CDS opciós ügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS23#26) – az egy alaptermékes CDS-ügyletnek az egy alaptermékes CDS-ügyletek eszköz-alosztálya tekintetében meghatározott alkategóriája	Azok a 0–6 hónapos lejárati csoportba tartozó egy alaptermékes CDS opciók, amelyek mögöttes egy alaptermékes CDS-ügylete likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriába tartozik, likvid piaccal rendelkezőnek minősülnek. Azok a nem a 0–6 hónapos lejárati csoportba tartozó egy alaptermékes CDS opciók, amelyek mögöttes egy alaptermékes CDS-ügylete likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriába tartozik, likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülnek.		

▼M3

Eszközosztály – Származtatott hitelügyletek				
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében adott esetben a kiegészítő minőségi likviditási kritériumot is alkalmazni kell.**		
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]	**Az index „on the run” státusa** [Kiegészítő minőségi likviditási kritérium]
	2. szegmentációs kritérium (RTS2#8) – az opció lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: **1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 6 hónap **2. lejárati csoport**: 6 hónap < futamidő ≤ 1 év **3. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év **4. lejárati csoport**: 2 év < futamidő ≤ 3 év … **m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év	Azok az egy alaptermékes CDS opciók, amelyek mögöttes egy alaptermékes CDS-ügylete likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő alkategóriába tartozik, egyetlen lejárati csoport esetében sem minősülnek likvid piaccal rendelkezőnek.		

Eszközosztály – Származtatott hitelügyletek	
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében a következő módszertant kell alkalmazni**
Egyéb származtatott hitelügyletek A fenti eszköz-alosztályok egyikébe sem tartozó származtatott hitelügyletek. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT** RTS2#5 = OTHR	Az egyéb származtatott hitelügyletek likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülnek.

▼M4

9.2. táblázat

Származtatott hitelügyletek – Likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek

Eszközosztály – Származtatott hitelügyletek									
Eszköz-alosztály	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**								
	A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek	**Kereskedés előtti LIS**		**Kereskedés utáni SSTI**			**Kereskedés utáni LIS**		
		Kereskedés – percentilis	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**
Indexhez kötött hitelnemteljesítési csereügyletek (CDS)	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Egy alaptermékes (single name) hitel-nemteljesítési csereügyletek (CDS)	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
CDS-index opciók	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Származtatott hitelügyletek									
Eszköz-alosztály	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**								
	A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek	**Kereskedés előtti LIS**		**Kereskedés utáni SSTI**			**Kereskedés utáni LIS**		
		Kereskedés – percentilis	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**
Egy alaptermékes (single name) CDS-opciók	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

9.3. táblázat

Származtatott hitelügyletek – Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek

Eszközosztály – Származtatott hitelügyletek			
Eszköz-alosztály	**Az egyes, likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek**		
	Kereskedés előtti LIS	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
	Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Indexhez kötött hitel-nemteljesítési csereügyletek (CDS)	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Egy alaptermékes (single name) hitel-nemteljesítési csereügyletek (CDS)	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
CDS-index opciók	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Egy alaptermékes (single name) CDS-opciók	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Egyéb származtatott hitelügyletek	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR

▼B

10. **„C10” típusú származtatott ügyletek**

▼M3

10.1. táblázat

„C10” típusú származtatott ügyletek – Likvid piaccal nem rendelkező osztályok

Eszközosztály – „C10” típusú származtatott ügyletek			
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének**	
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
Származtatott fuvardíj-ügyletek A 2014/65/EU irányelv I. melléklete C. szakaszának 10. pontjában meghatározott, fuvardíjakhoz kapcsolódó pénzügyi eszköz. RTS2#3 = DERV és RTS2#4 = COMM és RTS23#35 = FRGT	A fuvardíjakhoz kapcsolódó származtatott ügyletek alkategóriáit a következő szegmentációs kritériumok alapján kell meghatározni: **1. szegmentációs kritérium** (RTS2#5) – szerződés típusa: határidős tőzsdei vagy opciós **2. szegmentációs kritérium** (RTS23#36) – szállítóeszköz típusa **3. szegmentációs kritérium** (RTS2#37) – szállítóeszköz altípusa **4. szegmentációs kritérium** (RTS2#12) – a szállítóeszköz altípusának megfelelő nagyságrend meghatározása **5. szegmentációs kritérium** (RTS2#13) – adott út- vagy időbérlet átlaga **6. szegmentációs kritérium** (RTS2#8) – a származtatott ügylet lejárati csoportja a következő meghatározás szerint: **1. lejárati csoport**: 0 < futamidő ≤ 1 hónap **2. lejárati csoport**: 1 hónap < futamidő ≤ 3 hónap **3. lejárati csoport**: 3 hónap < futamidő ≤ 6 hónap **4. lejárati csoport**: 6 hónap < futamidő ≤ 9 hónap **5. lejárati csoport**: 9 hónap < futamidő ≤ 1 év **6. lejárati csoport**: 1 év < futamidő ≤ 2 év	10 000 000 EUR	10

▼M3

Eszközosztály – „C10” típusú származtatott ügyletek			
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének**	
		Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
	7. lejárati csoport: 2 év < futamidő ≤ 3 év … **m. lejárati csoport**: (n–1) év < futamidő ≤ n év		

Eszközosztály – „C10” típusú származtatott ügyletek	
Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében a következő módszertant kell alkalmazni**
Egyéb „C10” típusú származtatott ügyletek A 2014/65/EU irányelv I. melléklete C. szakaszának 10. pontjában meghatározott, fuvardíjakhoz kapcsolódó származtatott ügyletnek nem minősülő pénzügyi eszközök és a következő származtatott kamatügylet eszköz-alosztályok bármelyike: többdevizás inflációs csereügyletek, többdevizás inflációs csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek, egydevizás inflációs csereügyletek, egydevizás inflációs csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek; továbbá a következő származtatott részvényügylet eszköz-alosztályok bármelyike: volatilitásindex-opciók, határidős tőzsdei volatilitásindex-ügyletek és tőzsdén kívüli határidős volatilitásindex-ügyletek, hozamvariancián alapuló csereügyletek, hozamvolatilitáson alapuló csereügyletek, hozamvariancián alapuló portfólió-csereügyletek, hozamvolatilitáson alapuló portfólió-csereügyletek.	Az egyéb „C10” típusú származtatott ügyletek likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülnek.

▼M4

10.2. táblázat

„C10” típusú származtatott ügyletek – Likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek

Eszközosztály – „C10” típusú származtatott ügyletek									
Eszköz-alosztály	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**								
	A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek	**Kereskedés előtti LIS**		**Kereskedés utáni SSTI**			**Kereskedés utáni LIS**		
		Kereskedés – percentilis	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**
Származtatott fuvardíj-ügyletek	A küszöbértékekre vonatkozó számításokat az eszköz-alosztály minden egyes alkategóriája tekintetében az alkategóriához tartozó pénzügyi eszközök vonatkozásában végrehajtott ügyletek figyelembevételével kell elvégezni.	70	50 000 EUR	80	60	75 000 EUR	90	70	100 000 EUR

10.3. táblázat

„C10” típusú származtatott ügyletek – Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek

Eszközosztály – „C10” típusú származtatott ügyletek			
Eszköz-alosztály	**Az egyes, likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek**		
	Kereskedés előtti LIS	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
	Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Származtatott fuvardíj-ügyletek	50 000 EUR	75 000 EUR	100 000 EUR
Egyéb „C10” típusú származtatott ügyletek	50 000 EUR	75 000 EUR	100 000 EUR

▼B

11. **Különbözeti ügyletek (CFD)**

▼M3

11.1. táblázat

CFD – Likvid piaccal nem rendelkező osztályok

Eszköz-alosztály	**A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani**	Minőségi likviditási kritérium	**Átlagos napi névleges összeg (ADNA)** [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
Devizaalapú CFD-ügyletek RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = CURR	A devizaalapú CFD-ügylet alkategóriáját az alapul szolgáló devizapár, azaz a CFD/különbözetre fogadási (spread bet) ügylet alapjául szolgáló két pénznem kombinációja alapján kell meghatározni. RTS2#30 és RTS2#31		50 000 000 EUR	100
Árualapú CFD-ügyletek RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = COMM	Az árualapú CFD-ügylet alkategóriáját a CFD/különbözetre fogadási (spread bet) ügylet alapjául szolgáló áru alapján kell meghatározni. RTS23#35 és RTS23#36 és RTS23#37		50 000 000 EUR	100
Részvényalapú CFD-ügyletek RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = EQUI	A részvényalapú CFD-ügylet alkategóriáját a CFD/különbözetre fogadási (spread bet) ügylet alapjául szolgáló tulajdonviszonyt megtestesítő értékpapír alapján kell meghatározni. RTS23/26	A részvényalapú CFD-ügylet likvid piaccal rendelkezőnek minősül, ha az alapjául szolgáló tulajdonviszonyt megtestesítő értékpapír a 600/2014/EU rendelet 2. cikke (1) bekezdése 17. pontjának b) alpontja értelmében likvid piaccal rendelkezik.		
Kötvényalapú CFD-ügyletek RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = BOND	A kötvényalapú CFD-ügylet alkategóriáját a CFD/különbözetre fogadási (spread bet) ügylet alapjául szolgáló kötvény, illetve határidős tőzsdei kötvényügylet alapján kell meghatározni. RTS23/26	A kötvényalapú CFD-ügylet likvid piaccal rendelkezőnek minősül, ha az alapjául szolgáló kötvény, illetve határidős tőzsdei kötvényügylet a 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal rendelkezik.		

▼M3

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében minden eszköz-alosztályt az alább előírt alkategóriákra kell lebontani	Minőségi likviditási kritérium	Átlagos napi névleges összeg (ADNA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	Átlagos napi ügyletszám [2. mennyiségi likviditási kritérium]
Határidős tőzsdei részvényügyleten vagy tőzsdén kívüli határidős részvényügyleten alapuló CFD-ügyletek RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = FTEQ	A határidős tőzsdei részvényügyleten vagy tőzsdén kívüli határidős részvényügyleten alapuló CFD-ügylet alkategóriáját a CFD/különbözetre fogadási (spread bet) ügylet alapjául szolgáló határidős tőzsdei részvényügylet vagy tőzsdén kívüli határidős részvényügylet alapján kell meghatározni. RTS23/26	A határidős tőzsdei részvényügyleten vagy tőzsdén kívüli határidős részvényügyleten alapuló CFD-ügylet likvid piaccal rendelkezőnek minősül, ha az alapjául szolgáló határidős tőzsdei részvényügylet vagy tőzsdén kívüli határidős részvényügylet a 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal rendelkezik.		
Részvényopción alapuló CFD-ügyletek RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OPEQ	A részvényopción alapuló CFD-ügylet alkategóriáját a CFD/különbözetre fogadási (spread bet) ügylet alapjául szolgáló részvényopció alapján kell meghatározni. RTS23/26	A részvényopción alapuló CFD-ügylet likvid piaccal rendelkezőnek minősül, ha az alapjául szolgáló részvényopció a 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal rendelkezik.		

Eszközosztály – Különbözeti ügyletek (CFD)

Eszköz-alosztály	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő pénzügyieszköz-osztályok meghatározása tekintetében a következő módszertant kell alkalmazni
Egyéb CFD-ügyletek	
A fenti eszköz-alosztályok egyikébe sem tartozó CFD/különbözetre fogadási (spread bet) ügyletek. RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OTHR	Az egyéb CFD/különbözetre fogadási (spread bet) ügyletek likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülnek.

▼M4

11.2. táblázat

CFD-ügyletek – Likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek

Eszközosztály – Különbözeti ügyletek (CFD)									
Eszköz-alosztály	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**								
	A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek	**Kereskedés előtti LIS**		**Kereskedés utáni SSTI**			**Kereskedés utáni LIS**		
		Kereskedés – percentilis	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**
Devizaalapú CFD-ügyletek	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal rendelkező devizaalapú CFD-szerződések vonatkozásában végrehajtott ügyletek.	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Árualapú CFD-ügyletek	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal rendelkező árualapú CFD-szerződések vonatkozásában végrehajtott ügyletek.	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Részvényalapú CFD-ügyletek	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal rendelkező részvényalapú CFD-szerződések vonatkozásában végrehajtott ügyletek.	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Kötvényalapú CFD-ügyletek	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal rendelkező részvényalapú CFD-szerződések vonatkozásában végrehajtott ügyletek.	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Különbözeti ügyletek (CFD)									
Eszköz-alosztály	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő alkategóriák esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**								
	A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek	**Kereskedés előtti LIS**		**Kereskedés utáni SSTI**			**Kereskedés utáni LIS**		
		Kereskedés – percentilis	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Volumen – percentilis**	**Küszöbérték alapja**
Határidős tőzsdei részvényügyleten vagy tőzsdén kívüli határidős részvény-ügyleten alapuló CFD-ügyletek	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal rendelkező határidős tőzsdei részvényügyleten vagy tőzsdén kívüli határidős részvényügyleten alapuló CFD-szerződések vonatkozásában végrehajtott ügyletek.	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Részvényopción alapuló CFD-ügyletek	A 6. cikk és a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában likvid piaccal rendelkező részvényopción alapuló CFD-szerződések vonatkozásában végrehajtott ügyletek.	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR

11.3. táblázat

CFD-ügyletek – Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek

Eszközosztály – Különbözeti ügyletek (CFD)			
Eszköz-alosztály	**Az egyes, likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek**		
	Kereskedés előtti LIS	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
	Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Devizaalapú CFD-ügyletek	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Árualapú CFD-ügyletek	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

▼M4

Eszközosztály – Különbözeti ügyletek (CFD)			
Eszköz-alosztály	**Az egyes, likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő alkategóriákra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek**		
	Kereskedés előtti LIS	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
	Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Részvényalapú CFD-ügyletek	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Kötvényalapú CFD-ügyletek	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Határidős tőzsdei részvényügyleten vagy tőzsdén kívüli határidős részvényügyleten alapuló CFD-ügyletek	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Részvényopción alapuló CFD-ügyletek	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Egyéb CFD/különbözetre fogadási (spread bet) ügyletek	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

12. **Kibocsátási egységek**

12.1. táblázat

Kibocsátási egységek – Likvid piaccal nem rendelkező osztályok

Eszközosztály – Kibocsátási egységek	
A 6a. cikk alkalmazásában likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő eszköz-alosztályok meghatározása tekintetében a következő módszertant kell alkalmazni:	
Eszköz-alosztály	**A likviditás meghatározása**
Európai kibocsátási egységek (EUA) A 2003/87/EK európai parlamenti és tanácsi irányelv ([1]) (kibocsátás-kereskedelmi rendszer) követelményeinek eleget tevőként elismert, egy tonna szén-dioxid-egyenértéknek (tCO_2e) megfelelő kibocsátásra feljogosító egységek. RTS2#3 = EMAL és RTS23#37 = EUAE	Az európai kibocsátási egységek (EUA) likvid piaccal rendelkezőnek minősülnek.
Egyéb kibocsátási egységek RTS2#3 = EMAL és RTS23#37 <> EUAE	Bármely egyéb kibocsátási egység likvid piaccal nem rendelkezőnek minősül.

([1]) Az Európai Parlament és a Tanács 2003/87/EK irányelve (2003. október 13.) az üvegházhatást okozó gázok kibocsátási egységei Közösségen belüli kereskedelmi rendszerének létrehozásáról és a 96/61/EK tanácsi irányelv módosításáról (HL L 275., 2003.10.25., 32. o., ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2003/87/oj).

▼M4

12.2. táblázat

Kibocsátási egységek – Kereskedés előtti LIS küszöbérték és kereskedés utáni méretküszöb

Eszközosztály – Kibocsátási egységek		
Eszköz-alosztály	**Kereskedés előtti LIS**	**Kereskedés utáni méretküszöb**
Európai uniós kibocsátási egységek (EUA)	5 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	25 000 tonna szén-dioxid-egyenérték
Egyéb kibocsátási egységek	Mérettől függetlenül	Mérettől függetlenül

▼B

13. **Kibocsátáskereskedelmi derivatívák**

▼M3

13.1. táblázat

Kibocsátáskereskedelmi derivatívák – Likvid piaccal nem rendelkező osztályok

	Eszközosztály – Kibocsátáskereskedelmi derivatívák	
Eszköz-alosztály	**Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének**	
	Átlagos napi összeg (ADA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
EUA-alapuló kibocsátáskereskedelmi derivatívák A 2014/65/EU irányelv I. melléklete C. szakaszának 4. pontjában meghatározott, európai kibocsátási egységeken (EUA) alapuló kibocsátáskereskedelmi egységekhez kapcsolódó pénzügyi eszköz. RTS2#3 = DERV és RTS2#4 = EMAL és RTS2#43 = EUAE	150 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	5

▼M3

Eszköz-alosztály	Eszközosztály – Kibocsátáskereskedelmi derivatívák	
	Az egyes alkategóriák a 6. cikk, valamint a 8. cikk (1) bekezdésének b) pontja alkalmazásában akkor minősülnek likvid piaccal nem rendelkezőnek, ha nem felelnek meg a mennyiségi likviditási kritériumok tekintetében előírt alábbi küszöbértékek mindegyikének	
	Átlagos napi összeg (ADA) [1. mennyiségi likviditási kritérium]	**Átlagos napi ügyletszám** [2. mennyiségi likviditási kritérium]
Európai légi közlekedési kibocsátási egységeken (EUAA) alapuló kibocsátáskereskedelmi derivatívák A 2014/65/EU irányelv I. melléklete C. szakaszának 4. pontjában meghatározott, európai légi közlekedési kibocsátási egységeken (EUAA) alapuló kibocsátáskereskedelmi egységekhez kapcsolódó pénzügyi eszköz. RTS2#3 = DERV és RTS2#4 = EMAL és RTS2#43 = EUAA	150 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	5
Igazolt kibocsátáscsökkentési egységeken (CER) alapuló kibocsátáskereskedelmi derivatívák A 2014/65/EU irányelv I. melléklete C. szakaszának 4. pontjában meghatározott, igazolt kibocsátáscsökkentési egységeken (CER) alapuló kibocsátáskereskedelmi egységekhez kapcsolódó pénzügyi eszköz. RTS2#3 = DERV és RTS2#4 = EMAL és RTS2#43 = CERE	150 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	5
Kibocsátáscsökkentési egységeken (ERU) alapuló kibocsátáskereskedelmi derivatívák A 2014/65/EU irányelv I. melléklete C. szakaszának 4. pontjában meghatározott, kibocsátáscsökkentési egységeken (ERU) alapuló kibocsátáskereskedelmi egységekhez kapcsolódó pénzügyi eszköz. RTS2#3 = DERV és RTS2#4 = EMAL és RTS2#43 = ERUE	150 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	5
Egyéb kibocsátáskereskedelmi derivatívák A 2003/87/EK irányelv (kibocsátás-kereskedelmi rendszer) követelményeinek eleget tevőként elismert, nem az EUA, az EUAA, a CER vagy az ERU eszköz-alosztályba tartozó kibocsátási egységen alapuló kibocsátáskereskedelmi derivatívák. RTS2#3 = DERV és RTS2#4 = EMAL és RTS2#43 = OTHR	Az egyéb kibocsátáskereskedelmi derivatívák likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülnek.	

▼M4

13.2. táblázat

Kibocsátáskereskedelmi derivatívák – Likvid piaccal rendelkezőnek minősülő eszköz-alosztályokra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek

Eszközosztály – Kibocsátáskereskedelmi derivatívák							
Eszköz-alosztály	**A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek**	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő eszköz-alosztályok esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**					
		Kereskedés előtti LIS		**Kereskedés utáni SSTI**		**Kereskedés utáni LIS**	
		Kereskedés – percentilis	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Küszöbérték alapja**
Európai kibocsátási egységeken (EUA) alapuló kibocsátáskereskedelmi derivatívák	Az összes európai kibocsátási egységeken (EUA) alapuló kibocsátáskereskedelmi derivatíva vonatkozásában végrehajtott ügyletek	70	50 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	80	90 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	90	100 000 tonna szén-dioxid-egyenérték
Európai légi közlekedési kibocsátási egységeken (EUAA) alapuló kibocsátáskereskedelmi derivatívák	Az összes légi közlekedési európai kibocsátási egységeken (EUAA) alapuló kibocsátáskereskedelmi derivatíva vonatkozásában végrehajtott ügyletek	70	25 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	80	40 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	90	50 000 tonna szén-dioxid-egyenérték
Igazolt kibocsátáscsökkentési egységeken (CER) alapuló kibocsátáskereskedelmi derivatívák	Az összes igazolt kibocsátáscsökkentési egységeken (CER) alapuló kibocsátáskereskedelmi derivatíva vonatkozásában végrehajtott ügyletek	70	25 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	80	40 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	90	50 000 tonna szén-dioxid-egyenérték

▼M4

Eszközosztály – Kibocsátáskereskedelmi derivatívák							
Eszköz-alosztály	**A küszöbértékek kiszámítása során figyelembe veendő ügyletek**	**A likvid piaccal rendelkezőnek minősülő eszköz-alosztályok esetében a kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek kiszámításához használandó percentilisértékek és küszöb-alapértékek**					
		Kereskedés előtti LIS		**Kereskedés utáni SSTI**		**Kereskedés utáni LIS**	
		Kereskedés – percentilis	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Küszöbérték alapja**	**Kereskedés – percentilis**	**Küszöbérték alapja**
Kibocsátáscsökkentési egységeken (ERU) alapuló kibocsátáskereskedelmi derivatívák	Az összes kibocsátáscsökkentési egységeken (ERU) alapuló kibocsátáskereskedelmi derivatíva vonatkozásában végrehajtott ügyletek	70	25 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	80	40 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	90	50 000 tonna szén-dioxid-egyenérték

13.3. táblázat

Kibocsátáskereskedelmi derivatívák – Likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő eszköz-alosztályokra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek

Eszközosztály – Kibocsátáskereskedelmi derivatívák			
Eszköz-alosztály	**Az egyes, likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő eszköz-alosztályokra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek**		
	Kereskedés előtti LIS	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
	Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Európai kibocsátási egységeken (EUA) alapuló kibocsátáskereskedelmi derivatívák	50 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	90 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	100 000 tonna szén-dioxid-egyenérték
Európai légi közlekedési kibocsátási egységeken (EUAA) alapuló kibocsátáskereskedelmi derivatívák	25 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	40 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	50 000 tonna szén-dioxid-egyenérték

▼M4

Eszközosztály – Kibocsátáskereskedelmi derivatívák			
Eszköz-alosztály	**Az egyes, likvid piaccal nem rendelkezőnek minősülő eszköz-alosztályokra alkalmazandó kereskedés előtti és kereskedés utáni SSTI és LIS küszöbértékek**		
	Kereskedés előtti LIS	**Kereskedés utáni SSTI**	**Kereskedés utáni LIS**
	Küszöbérték	**Küszöbérték**	**Küszöbérték**
Igazolt kibocsátáscsökkentési egységeken (CER) alapuló kibocsátáskereskedelmi derivatívák	25 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	40 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	50 000 tonna szén-dioxid-egyenérték
Kibocsátáscsökkentési egységeken (ERU) alapuló kibocsátáskereskedelmi derivatívák	25 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	40 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	50 000 tonna szén-dioxid-egyenérték
Egyéb kibocsátáskereskedelmi derivatívák	25 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	40 000 tonna szén-dioxid-egyenérték	50 000 tonna szén-dioxid-egyenérték

▼B

IV. MELLÉKLET

Az átláthatósági számítások céljára benyújtandó referenciaadatok

▼M3
▼C1

1. táblázat

A 2. táblázatban használt jelölések magyarázata

JELÖLÉS	ADATTÍPUS	MEGHATÁROZÁS
{ALPHANUM-n}	Legfeljebb n számú alfanumerikus karakter	Szövegmező
{DECIMAL-n/m}	Legfeljebb n számjegyből álló tizedes tört, amely legfeljebb m számú tizedesjegyet tartalmazhat	Numerikus mező pozitív és negatív értékek megadásához 1. tizedesjel: „,” (vessző); 2. a negatív számok „–” (mínusz) előjellel jelölhetők. Az értékeket – ahol szükséges – kerekíteni kell, azaz nem csonkolhatók.
{COUNTRYCODE_2}	2 alfanumerikus karakter	Az ISO 3166-1 alpha-2 országkódoknak megfelelő kétbetűs országkód
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerikus karakter	Az ISO 4217 szabvány szerinti pénznemkódoknak megfelelő hárombetűs pénznemkód
{DATEFORMAT}	Az ISO 8601 szabványnak megfelelő dátumformátum	A dátumokat a következő formátumban kell megadni: ÉÉÉÉ-HH-NN
{ISIN}	12 alfanumerikus karakter	Az ISO 6166 szabványnak megfelelő ISIN-kód
{LEI}	20 alfanumerikus karakter	Az ISO 17442 szabványnak megfelelő jogalany-azonosító
{MIC}	4 alfanumerikus karakter	Az ISO 10383 szabványnak megfelelő piacazonosító
{EIC}	16 alfanumerikus karakter	Az Európai Unión belüli vagy kívüli szállítási pontnak megfelelő EIC-kód
{INDEX}	4 alfabetikus karakter	„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

JELÖLÉS	ADATTÍPUS	MEGHATÁROZÁS
		„CIBO” — CIBOR „MOSP” — MOSPRIM „NIBO” — NIBOR „PRBO” — PRIBOR „TLBO” — TELBOR „WIBO” — WIBOR „TREA” — Treasury „SWAP” — SWAP „FUSW” — Future SWAP

▼M3

2. táblázat

Az átláthatósági számítások céljára benyújtandó referenciaadatok részletezése

#	MEZŐ	BEJELENTENDŐ ADATOK	AZ ADATSZOLGÁLTATÁS FORMÁTUMA
1	Eszközazonosító kód	A pénzügyi eszköz azonosításához használt kód	{ISIN}
2	Eszköz teljes neve	A pénzügyi eszköz teljes neve	{ALPHANUM-350}
3	MiFIR azonosító	**A nem tulajdonviszonyt megtestesítő pénzügyi eszközök azonosítója:** **Értékpapírosított származtatott ügyletek** – a III. melléklet 4. szakasza 4.1. táblázatának meghatározása szerint. **Strukturált pénzügyi termékek (SFP)** – a 600/2014/EU rendelet 2. cikke (1) bekezdése 28. pontjának meghatározása szerint. **Kötvények (kivéve ETC és ETN)** – a 2014/65/EU irányelv 4. cikke (1) bekezdése 44. pontja b) alpontjának meghatározása szerint. **ETC** – a 2014/65/EU irányelv 4. cikke (1) bekezdése 44. pontja b) alpontjának meghatározása, valamint a III. melléklet 2. szakasza 2.4. táblázatának részletesebb meghatározása szerint. **ETN** – a 2014/65/EU irányelv 4. cikke (1) bekezdése 44. pontja b) alpontjának meghatározása, valamint a III. melléklet 2. szakasza 2.4. táblázatának részletesebb meghatározása szerint. **Kibocsátási egységek** – a III. melléklet 12. szakasza 12.1. táblázatának meghatározása szerint. **Származtatott ügyletek** – a 2014/65/EU irányelv I. melléklete C. szakasza 4–10. pontjának meghatározása szerint.	**Nem tulajdonviszonyt megtestesítő pénzügyi eszközök:** „SDRV” – értékpapírosított származtatott ügylet „SFPS” – strukturált pénzügyi termék (SFP) „BOND” – kötvény „ETCS” – ETC „ETNS” – ETN „EMAL” – kibocsátási egység „DERV” – származtatott ügylet

▼M3

#	MEZŐ	BEJELENTENDŐ ADATOK	AZ ADATSZOLGÁLTATÁS FORMÁTUMA
4	Az alaptermék eszközosztálya	Ezt a mezőt csak akkor kell kitölteni, ha a MiFIR-azonosító értékpapírosított származtatott ügylet vagy származtatott ügylet.	„INTR” – kamatláb „EQUI” – részvény „COMM” – áru „CRDT” – hitel „CURR” – deviza „EMAL” – kibocsátási egység „OCTN” – egyéb C10
5	Szerződés típusa	Ezt a mezőt csak akkor kell kitölteni, ha a MiFIR-azonosító származtatott ügylet.	„OPTN” – opciós ügylet „FUTR” – határidős tőzsdei ügylet (ideértve a tőzsdén kívüli határidős fuvardíj-megállapodásokat (FFA)) „FRAS” – tőzsdén kívüli határidős kamatláb-megállapodás (FRA) „FORW” – tőzsdén kívüli határidős ügylet „SWAP” – csereügylet „PSWP” – portfólió-csereügylet „SWPT” – csereügyletre szóló opció „OPTS” – csereügylet-alapú opció „FONS” – határidős tőzsdei csereügylet „FWOS” – tőzsdén kívüli határidős csereügylet „SPDB” – különbözetre fogadási (spread bet) ügylet „CFDS” – CFD „OTHR” – egyéb
6	A beszámolás tárgynapja	A szolgáltatott referenciaadatok dátuma	{DATEFORMAT}
7	Kereskedési helyszín	A kereskedési helyszínhez tartozó szegmensazonosító MIC-kód, ha rendelkezésre áll; egyéb esetben a működtetőazonosító MIC-kód.	{MIC}
8	Lejárat	A pénzügyi eszköz meghatározott lejárati ideje. A mező a kötvények, a származtatott kamatügyletek, a származtatott részvényügyletek, a származtatott áruügyletek, a származtatott devizaügyletek, a származtatott hitelügyletek, a „C10” típusú származtatott ügyletek, valamint a kibocsátáskereskedelmi derivatívák eszközosztályára alkalmazandó.	{DATEFORMAT}

Kötvényekre (minden kötvénytípus, kivéve ETC és ETN) vonatkozó mezők

Az e szakaszban található mezőket csak a III. melléklet 2. szakaszának 2.1. táblázata szerinti kötvények esetében kell kitölteni.

9	Kötvénytípus	A III. melléklet 2. szakaszának 2.2. táblázata szerinti kötvénytípus. Ezt a mezőt csak akkor kell kitölteni, ha a MiFIR-azonosító értéke „kötvény”.	„EUSB” – államkötvény „OEPB” – egyéb közintézményi kötvény „CVTB” – átváltoztatható kötvény „CVDB” – fedezett kötvény „CRPB” – vállalati kötvény „OTHR” – egyéb

▼M3

10	Kibocsátás időpontja	Az a nap, amelyen a kötvényt kibocsátották, és az elkezd kamatot felhalmozni.	{DATEFORMAT}

Kibocsátási egységekre vonatkozó mezők

Az e szakaszban található mezőket csak a III. melléklet 12. szakaszának 12.1. táblázata szerinti kibocsátási egységek esetében kell kitölteni.

11	Kibocsátási egység altípusa	Kibocsátási egységek	„CERE” – CER „ERUE” – ERU „EUAE” – EUA „EUAA” – EUAA „OTHR” – egyéb

Származtatott ügyletekre vonatkozó mezők

Származtatott áruügyletek és „C10” típusú származtatott ügyletek

Az e szakaszban található mezőket csak a III. melléklet 7. szakaszának 7.1. táblázata szerinti származtatott áruügyletek és a III. melléklet 10. szakaszának 10.1. táblázata szerinti C10 típusú származtatott ügyletek esetében kell kitölteni.

12	A szállítóeszköz altípusának megfelelő nagyságrend meghatározása	Ezt a mezőt csak akkor kell kitölteni, ha az (EU) 2017/585 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet melléklete 2. táblázata 35. mezőjének értéke „fuvardíj”.	Szárazáru-fuvarozás esetében: „CAPE” – Capesize „PNMX” – Panamax „SPMX” – Supramax „HAND” – Handysize Nedvesáru-fuvarozás esetében: „CLAN” – tiszta („clean”) „DRTY” – szennyezett („dirty”) {ALPHANUM-4} egyéb
13	Adott út- vagy időbérlet átlaga	Ezt a mezőt csak akkor kell kitölteni, ha az (EU) 2017/585 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet melléklete 2. táblázata 35. mezőjének értéke „fuvardíj”.	Nedvesáru-fuvarozás esetében: „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

			Szárazáru-fuvarozás esetében: „4TC” – 4TC „5TC” – 5TC „6TC” – 6TC „10TC” – 10TC „C3” – C3 „C5” – C5 „C7” – C7 „P1A” – P1A „P2A” – P2A „P3A” – P3A „P1E” – P1E „P2E” – P2E „P3E” – P3E {ALPHANUM-6} egyéb
14	Szállítás, illetve készpénzes kiegyenlítés helye	Ezt a mezőt csak akkor kell kitölteni, ha az (EU) 2017/585 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet melléklete 2. táblázata 35. mezőjének értéke „energia”.	{EIC} villamos energia vagy földgáz esetében „OTHR” – egyéb
15	Névleges pénznem	A névérték denominálási pénzneme.	{CURRENCYCODE_3}

Származtatott kamatügyletek

Az e szakaszban található mezőket csak a III. melléklet 5. szakaszának 5.1. táblázata szerinti származtatott kamatügyletek esetében kell kitölteni.

16	Alaptermék típusa	Ezt a mezőt csak a csereügyletektől, csereügyletre szóló opcióktól, határidős tőzsdei csereügyletektől és tőzsdén kívüli határidős csereügyletektől eltérő ügyletek esetében kell kitölteni az alábbi lehetőségek egyikével: ********** Ezt a mezőt csak a csereügyletektől, csereügyletre szóló opcióktól, határidős tőzsdei csereügyletektől és tőzsdén kívüli határidős csereügyletektől eltérő ügyletek esetében kell kitölteni az alábbi lehetőségek egyikével:	„BOND” – kötvény „BNDF” – kötvényeken alapuló határidős tőzsdei ügylet „INTR” – kamatláb „IFUT” – határidős tőzsdei kamatlábügylet ********** „FFMC” – többdevizás változókamat-csereügyletek „XFMC” – többdevizás rögzített–változó kamat-csereügyletek „XXMC” – többdevizás rögzítettkamat-csereügyletek „OSMC” – többdevizás OIS csereügyletek „IFMC” – többdevizás inflációs csereügyletek „FFSC” – egydevizás változókamat-csereügyletek „XFSC” – egydevizás rögzített–változó kamat-csereügyletek

▼M3

			„XXSC” – egydevizás rögzítettkamat-csereügyletek „OSSC” – egydevizás OIS csereügyletek „IFSC” – egydevizás inflációs csereügyletek
17	Alapkötvény kibocsátója	Ezt a mezőt csak akkor kell kitölteni a közvetlen vagy végső alapkötvény kibocsátójának jogalany-azonosító kódjával (LEI), ha az alaptermék kötvény vagy határidős tőzsdei kötvényügylet.	{LEI}
18	Az alapkötvény lejáratának napja	Ebben a mezőben az alapkötvény meghatározott lejárati napját kell megadni.	{DATEFORMAT}
19	Az alapkötvény kibocsátásának napja	Ebben a mezőben az alapkötvény kibocsátási dátumát kell megadni.	{DATEFORMAT}
20	A csereügyletre szóló opció névleges pénzneme	Csak csereügyletre szóló opciók esetében kell kitölteni.	{CURRENCYCODE_3}
21	Az alapul szolgáló csereügylet lejáratának napja	Csak csereügyletre szóló opciók, csereügylet-alapú opciók, határidős tőzsdei csereügyletek és tőzsdén kívüli határidős csereügyletek esetében kell kitölteni.	{DATEFORMAT}
22	Az inflációs index / alapkötvény ISIN-kódja	Csereügyletre szóló opciók esetében az alapul szolgáló csereügylet típusa az alábbi lehetőségek közül: egydevizás inflációs csereügyletek, egydevizás inflációs csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek; többdevizás inflációs csereügyletek, többdevizás inflációs csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek; amennyiben az inflációs index rendelkezik ISIN-kóddal, a mezőben ezt a kódot kell megadni. ********** Kötvényopciók, kötvényopcióra vonatkozó opciók, határidős tőzsdei kötvényügyletre vonatkozó opciók esetében a végső alapkötvény ISIN-kódját kell megadni.	{ISIN} ********** {ISIN}

▼M3

23	Inflációs index neve	Ebben a mezőben a következő mögöttes csereügyletek egyikén alapuló csereügyletre szóló opciók esetében az index standard nevét kell megadni: egydevizás inflációs csereügyletek, egydevizás inflációs csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek; többdevizás inflációs csereügyletek, többdevizás inflációs csereügyleten alapuló határidős tőzsdei ügyletek és tőzsdén kívüli határidős ügyletek;	{ALPHANUM-25}
24	Referencia-kamatláb	A referencia-kamatláb neve.	{INDEX} vagy {ALPHANUM-25} – ha az {INDEX} lista nem tartalmazza a referencia-kamatlábat
25	Alapul szolgáló kamatláb futamideje	Ebben a mezőben a szerződés alapjául szolgáló kamatláb futamidejét kell megadni. A futamidőt napokban, hetekben, hónapokban vagy években kell kifejezni. A legnagyobb futamidőegységgel (év) kezdve lefelé haladva, ha a kamatláb futamideje egész szám, akkor ezt a szokásos feltételt ebben a mezőben kell kitölteni.	INTEGER-3+„DAYS” – napok INTEGER-3+„WEEK” – hetek INTEGER-3+„MNTH” – hónapok INTEGER-3+„YEAR” – évek

Származtatott devizaügyletek

Az e szakaszban található mezőket csak a III. melléklet 8. szakaszának 8.1. táblázata szerinti származtatott devizaügyletek esetében kell kitölteni.

26	Szerződés altípusa	Ebben a mezőben a leszállításos és a nem leszállításos tőzsdén kívüli határidős ügyletek, opciók és csereügyletek közötti különbségtétel lehetővé tétele érdekében kell kitölteni a III. melléklet 8. szakaszának 8.1. táblázata szerint.	„DLVB” – leszállításos „NDLV” – nem leszállításos

Származtatott részvényügyletek

Ezt a mezőt csak a III. melléklet 6. szakaszának 6.1. táblázata szerinti származtatott részvényügyletek esetében kell kitölteni.

27	Alaptermék típusa	Ezt a mezőt akkor kell kitölteni, ha a MiFIR-azonosító értéke „származtatott ügylet”, az alaptermék eszközosztálya „részvény”, és az eszköz-alosztály nem „csereügylet” vagy „portfólió-csereügylet”.	„STIX” – részvényindex „SHRS” – részvény „DIVI” – osztalékindex „DVSE” – részvényosztalék „BSKT” – vállalati intézkedéssel létrehozott részvénykosár „ETFS” – ETF „VOLI” – volatilitásindex „OTHR” – egyéb (többek között letéti igazolások, certifikátok és egyéb részvényjellegű pénzügyi eszközök)

▼M3

		********** Ezt a mezőt akkor kell kitölteni, ha a MiFIR-azonosító értéke „származtatott ügylet”, az alaptermék eszközosztálya „részvény”, az eszköz-alosztály „csereügylet” vagy „portfólió-csereügylet”, és a III. melléklet 6. szakaszának 6.1. táblázatában meghatározott 2. szegmentációs kritérium értéke „egy alaptermékes”.	********** „SHRS” – részvény „DVSE” – részvényosztalék „ETFS” – ETF „OTHR” – egyéb (többek között letéti igazolások, certifikátok és egyéb részvényjellegű pénzügyi eszközök)
		********** Ezt a mezőt akkor kell kitölteni, ha a MiFIR-azonosító értéke „származtatott ügylet”, az alaptermék eszközosztálya „részvény”, az eszköz-alosztály „csereügylet” vagy „portfólió-csereügylet”, és a III. melléklet 6. szakaszának 6.1. táblázatában meghatározott 2. szegmentációs kritérium értéke „index”.	********** „STIX” – részvényindex „DIVI” – osztalékindex „VOLI” – volatilitásindex „OTHR” – egyéb
		********** Ezt a mezőt akkor kell kitölteni, ha a MiFIR-azonosító értéke „származtatott ügylet”, az alaptermék eszközosztálya „részvény”, az eszköz-alosztály „csereügylet” vagy „portfólió-csereügylet”, és a III. melléklet 6. szakaszának 6.1. táblázatában meghatározott 2. szegmentációs kritérium értéke „kosár”.	********** „BSKT” – kosár
28	Paraméter	Ezt a mezőt akkor kell kitölteni, ha a MiFIR-azonosító értéke „származtatott ügylet”, az alaptermék eszközosztálya „részvény”, és az eszköz-alosztály az alábbiak egyike: csereügylet, portfólió-csereügylet.	„PRBP” – Árfolyamnyereség alapteljesítmény paraméter „PRDV” – Osztalékhozam paraméter „PRVA” – Hozamvariancia paraméter „PRVO” – Hozamvolatilitás paraméter

Különbözeti ügyletek (CFD)

Ezt a mezőt csak akkor kell kitölteni, ha a szerződés típusa „különbözeti ügylet” vagy „különbözetre fogadási ügylet”.

29	Alaptermék típusa	Ezt a mezőt akkor kell kitölteni, ha a MiFIR-azonosító értéke „származtatott ügylet”, és ha a szerződés típusa „különbözeti ügylet” vagy „különbözetre fogadási ügylet”.	„CURR” – deviza „EQUI” – részvény „BOND” – kötvény „FTEQ” – határidős tőzsdei részvényügylet / tőzsdén kívüli határidős részvényügylet „OPEQ” – részvényopció „COMM” – áru „EMAL” – kibocsátási egység „OTHR” – egyéb

▼M3

30	Névleges pénznem 1	Az alapul szolgáló devizapár egyik pénzneme. Ezt a mezőt csak akkor kell kitölteni, ha az alaptermék típusa „deviza”.	{CURRENCYCODE_3}
31	Névleges pénznem 2	Az alapul szolgáló devizapár másik pénzneme. Ezt a mezőt csak akkor kell kitölteni, ha az alaptermék típusa „deviza”.	{CURRENCYCODE_3}

Származtatott hitelügyletek

Az e szakaszban található mezőket csak a III. melléklet 9. szakaszának 9.1. táblázata szerinti kötvények esetében kell kitölteni.

32	Az alapul szolgáló hitel-nemteljesítési csereügylet ISIN-kódja.	Ezt a mezőt hitel-nemteljesítési csereügyleten alapuló származtatott ügyletek esetében kell kitölteni az alapul szolgáló csereügylet ISIN-kódjával.	{ISIN}
33	Alapul szolgáló index kódja	Ezt a mezőt CDS-indexen alapuló származtatott ügyletek esetében kell kitölteni az alapul szolgáló index ISIN-kódjával.	{ISIN}
34	Alapul szolgáló index neve	Ezt a mezőt CDS-indexen alapuló származtatott ügyletek esetében kell kitölteni az alapul szolgáló index standard nevével.	{ALPHANUM-25}
35	Sorozat	Adott esetben az index összeállításának sorozatszáma. Ezt a mezőt CDS-indexek vagy CDS-indexen alapuló származtatott ügyletek esetében kell kitölteni a CDS-index sorozatszámával.	{DECIMAL-18/17}
36	Verzió	Egy sorozatnak akkor bocsátják ki új verzióját, ha az abban szereplő nemteljesítések valamelyikét és az indexet újra kell súlyozni az indexet alkotó elemek számának változása miatt. Ezt a mezőt CDS-indexek vagy CDS-indexen alapuló származtatott ügyletek esetében kell kitölteni a CDS-index verziószámával.	{DECIMAL-18/17}
37	A gördülő időszak által lefedett hónapok	A gördülő időszaknak az index szolgáltatója által az adott évre előirányzott terv szerint várható összes hónapja. A mezőt a gördülő időszak összes hónapja esetében meg kell ismételni. Ezt a mezőt CDS-indexek vagy CDS-indexen alapuló származtatott ügyletek esetében kell kitölteni.	„01”, „02”, „03”, „04”, „05”, „06”, „07”, „08”, „09”, „10”, „11”, „12”
38	A következő gördülő nap	Ezt a mezőt CDS-indexek vagy CDS-indexen alapuló származtatott ügyletek esetében kell kitölteni az index szolgáltatója által kijelölt következő gördülő nappal.	{DATEFORMAT}
39	Állami vagy nyilvános típusú kibocsátó	Ezt a mezőt akkor kell kitölteni, ha az egy alaptermékes CDS vagy az egy alaptermékes CDS-en alapuló származtatott ügylet renerencia-jogalanya a III. melléklet 9. szakaszának 9.1. táblázata szerinti állampapír-kibocsátó.	„IGEN” – a referencia-jogalany állami vagy nyilvános típusú kibocsátó „Nem” – a referencia-jogalany nem állami vagy nyilvános típusú kibocsátó

▼M3

40	Referenciakötelezettség	Ezt a mezőt egy alaptermékes hitelnemteljesítési csereügyleten alapuló származtatott ügyletek esetében kell kitölteni a referenciakötelezettség ISIN-kódjával.	{ISIN}
41	Referencia-jogalany	Ebben a mezőben az egy alaptermékes CDS vagy egy alaptermékes CDS-en alapuló származtatott ügylet referencia-jogalanyát kell megadni.	{COUNTRYCODE_2} vagy Az ISO 3166-2 kód – kétbetűs országkód, kötőjel („-”) és az ország alegységének legfeljebb három alfanumerikus karakterből álló kódja. vagy {LEI}
42	Névleges pénznem	A névérték denominálási pénzneme.	{CURRENCYCODE_3}

Kibocsátáskereskedelmi derivatívák

Az e szakaszban található mezőket csak a III. melléklet 13. szakaszának 13.1. táblázata szerinti kibocsátáskereskedelmi derivatívák esetében kell kitölteni.

43	Kibocsátáskereskedelmi derivatíva altípusa	Ezt a mezőt akkor kell kitölteni, ha a #3 változó („MiFIR-azonosító”) értéke „DERV” (származtatott ügylet) és a #4 változó („alaptermék eszközosztálya”) értéke „EMAL” (kibocsátási egység).	„CERE” – CER „ERUE” – ERU „EUAE” – EUA „EUAA” – EUAA „OTHR” – egyéb

▼M3

V. MELLÉKLET

Az átláthatósági számítások céljára benyújtandó mennyiségi adatok

1. táblázat

A 2. táblázatban használt jelölések magyarázata

Jelölés	Adattípus	Meghatározás
{ALPHANUM-n}	Legfeljebb n számú alfanumerikus karakter	Szövegmező
{ISIN}	12 alfanumerikus karakter	Az ISO 6166 szabványnak megfelelő ISIN-kód
{MIC}	4 alfanumerikus karakter	Az ISO 10383 szabványnak megfelelő piacazonosító
{DATEFORMAT}	Az ISO 8601 szabványnak megfelelő dátumformátum	A dátumokat a következő formátumban kell megadni: ÉÉÉÉ-HH-NN
{DECIMAL-n/m}	Összesen legfeljebb n számjegyből álló tizedes tört, amely legfeljebb m számú tizedesjegyet tartalmazhat	Numerikus mező pozitív és negatív értékek megadásához tizedesjel: „,” (vessző); a negatív számok előtt „–” (mínusz) jelet kell használni; az értékeket kerekíteni kell, nem csonkítani
{INTEGER-n}	Legfeljebb n számjegyből álló egész szám	Numerikus mező pozitív és negatív egész számértékek megjelöléséhez.

2. táblázat

A nem tulajdonviszonyt megtestesítő pénzügyi eszközök likvid piacának, valamint LIS és SSTIküszöbértékeinek meghatározásához benyújtandó részletes adatok

#	Mező	Bejelentendő adatok	Végrehajtási/közzétevő helyszín típusa	Az adatszolgáltatás formátuma és az alkalmazandó előírások
1	Eszközazonosító kód	A pénzügyi eszköz azonosításához használt kód	Szabályozott piac (RM) Multilaterális kereskedési rendszer (MTF) Szervezett kereskedési rendszer (OTF) Jóváhagyott közzétételi mechanizmus (APA) Összesítettadat-szolgáltató (CTP)	{ISIN}
2	Végrehajtás napja	Az ügylet végrehajtásának napja.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DATEFORMAT}

▼M3

#	Mező	Bejelentendő adatok	Végrehajtási/közzétevő helyszín típusa	Az adatszolgáltatás formátuma és az alkalmazandó előírások
3	Végrehajtás helyszíne	Az uniós kereskedési helyszín vagy rendszeres internalizáló szegmensazonosító MIC-kódja, ha rendelkezésre áll; egyéb esetben a működtetőazonosító MIC-kód. A rendszeres internalizáló szegmensazonosító MIC-kódja, ha rendelkezésre áll; egyéb esetben a működtetőazonosító MIC-kód. OTC-ügyletek esetében a XOFF MIC-kód. Adott ISIN és végrehajtási dátum tekintetében az APA-nak az eszközre vonatkozó minden OTC kereskedési tevékenységet egyetlen adatrekordban kell összegeznie (ISIN, XOFF, végrehajtás dátuma).	RM, MTF, OTF, APA, CTP	A kereskedési helyszín vagy a rendszeres internalizáló MIC-kódja {MIC} vagy „XOFF”
4	Felfüggesztett eszköz jelzése	Azt jelzi, hogy az eszköz a végrehajtás napján fel volt-e függesztve a teljes kereskedési napra az adott kereskedési helyszínen. Amennyiben igen, az 5. mezőben nulla értéket kell megadni.	RM, MTF, OTF	„IGEN” – az eszköz a teljes kereskedési napra fel volt függesztve „NEM” – az eszköz nem volt a teljes kereskedési napra felfüggesztve
5	Ügyletek teljes száma	A végrehajtás napján végrehajtott ügyletek teljes száma. A törölt ügyleteket ki kell zárni a jelentett adatokból. A halasztott közzététel előnyeit élvező ügyleteket a végrehajtás napja alapján kell beszámítani a benyújtó szervezetek által rendelkezésre bocsátott aggregátumokba. A mezőt minden esetben ki kell tölteni nulla vagy pozitív értékkel. Az egész napra felfüggesztett eszközök esetében nulla értéket kell megadni.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
6	Teljes volumen	A végrehajtás napján végrehajtott teljes volumen. A volument e rendelet II. mellékletének 4. táblázata szerint kell mérni. A pénzösszegeket euróban kell megadni. A törölt ügyleteket ki kell zárni a jelentett adatokból. A halasztott közzététel előnyeit élvező ügyleteket a végrehajtás napja alapján kell beszámítani a benyújtó szervezetek által rendelkezésre bocsátott aggregátumokba.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

▼M3

#	Mező	Bejelentendő adatok	Végrehajtási/közzétevő helyszín típusa	Az adatszolgáltatás formátuma és az alkalmazandó előírások
7	Ügyletméret-tartomány	Ezt a mezőt az e melléklet 3. és 4. táblázatában megadott értékekkel kell kitölteni. A következőkben meghatározott ügyletméretkosár-tartomány: e melléklet 4. táblázata a kibocsátási egységek és azokon alapuló származtatott ügyletek esetében; e melléklet 3. táblázata a többi eszköz esetében. A teljes napra felfüggesztett instrumentumok esetében e mező, valamint a 8. és 9. mező adatait nem kell megadni.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{ALPHANUM - -140}
8	Az adott kosárban végrehajtott ügyletek száma összesen	A végrehajtás napján végrehajtott, a kosár tartományába eső ügyletek teljes száma. A törölt ügyleteket ki kell zárni a jelentett adatokból. A halasztott közzététel előnyeit élvező ügyleteket a végrehajtás napja alapján kell beszámítani a benyújtó szervezetek által rendelkezésre bocsátott aggregátumokba.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
9	Az adott kosárban kereskedett teljes volumen	A beszámolás napján végrehajtott, a kosár tartományába eső ügyletek teljes volumene. A volument e rendelet II. mellékletének 4. táblázata szerint kell mérni. A pénzösszegeket euróban kell megadni. A törölt ügyleteket ki kell zárni a jelentett adatokból. A halasztott közzététel előnyeit élvező ügyleteket a végrehajtás napja alapján kell beszámítani a benyújtó szervezetek által rendelkezésre bocsátott aggregátumokba.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

▼M3

3. táblázat

Kötvények, SFP-k, értékpapírosított származtatott ügyletek, származtatott kamatügyletek, származtatott részvényügyletek, származtatott devizaügyletek, származtatott hitelügyletek, származtatott áruügyletek, „C10” típusú származtatott ügyletek és CFD-k kereskedési mérettartományai

Alkalmazási kör	Ügyletméret-tartomány	Meghatározás
1,000,000 alatti nagyságrendű ügyletek	]0 – 100,000[	100,000 EUR alatti kereskedési nagyságrendű ügyletek
	[100,000 – 100,000]	100,000 EUR összegű kereskedési nagyságrendű ügyletek
	]100,000 – 200,000[	100,000 EUR feletti, de 200,000 EUR alatti kereskedési nagyságrendű ügyletek
	[200,000 – 300,000[	Legalább 200,000 EUR összegű, de 300,000 EUR alatti kereskedési nagyságrendű ügyletek
	[300,000 – 400,000[	Legalább 300,000 EUR összegű, de 400,000 EUR alatti kereskedési nagyságrendű ügyletek
	[Y – Y+100,000[	Legalább Y EUR összegű, de Y + 100,000 EUR alatti kereskedési nagyságrendű ügyletek (100,000 EUR lépésköz)
	[900,000 – 1,000,000[	Legalább 900,000 EUR összegű, de 1,000,000 EUR alatti kereskedési nagyságrendű ügyletek
Legalább 1,000,000 és kisebb mint 10,000,000 közötti nagyságrendű ügyletek	[1,000,000 – 1,500,000[	Legalább 1,000,000 EUR összegű, de 1,500,000 EUR alatti kereskedési nagyságrendű ügyletek
	[1,500,000 – 2,000,000[	Legalább 1,500,000 EUR összegű, de 2,000,000 EUR alatti kereskedési nagyságrendű ügyletek
	[Z – Z+500,000[	Legalább Z EUR összegű, de Z+ 500,000 EUR alatti kereskedési nagyságrendű ügyletek (500,000 EUR lépésköz)
	[9,500,000 – 10,000,000[	Legalább 9,500,000 EUR összegű, de 10,000,000 EUR alatti kereskedési nagyságrendű ügyletek
Legalább 10,000,000 és kisebb mint 100,000,000 közötti nagyságrendű ügyletek	[10,000,000 – 15,000,000[	Legalább 10,000,000 EUR összegű, de 15,000,000 EUR alatti kereskedési nagyságrendű ügyletek
	[15,000,000 – 20,000,000[	Legalább 15,000,000 EUR összegű, de 20,000,000 EUR alatti kereskedési nagyságrendű ügyletek
	[W – W+ 5,000,000[	Legalább W EUR összegű, de W+5,000,000 EUR alatti kereskedési nagyságrendű ügyletek (5,000,000 EUR lépésköz)
	[95,000,000 – 100,000,000[	Legalább 95,000,000 EUR összegű, de 100,000,000 EUR alatti kereskedési nagyságrendű ügyletek
Legalább 100,000,000 nagyságrendű ügyletek	[100,000,000 – 125,000,000[	Legalább 100,000,000 EUR összegű, de 125,000,000 EUR alatti kereskedési nagyságrendű ügyletek
	[125,000,000 – 150,000,000[	Legalább 125,000,000 EUR összegű, de 150,000,000 EUR alatti kereskedési nagyságrendű ügyletek
	[X – X+25,000,000[	Legalább X EUR összegű, de X+25,000,000 EUR alatti kereskedési nagyságrendű ügyletek (25,000,000 EUR lépésköz)
…	…	…

▼M3

4. táblázat

A kibocsátási egységekre és a kibocsátási egységeken alapuló származtatott ügyletekre vonatkozó ügyletméret-tartományok

Alkalmazási kör	Ügyletméretkosár	Meghatározás
1,000,000 alatti nagyságrendű ügyletek	0–100,000	100,000 tonna szén-dioxid-egyenértéknél (tCO_2e) kisebb kereskedelmi nagyságrendű ügyletek
	100,000–100,000	100,000 tCO_2e-kel megegyező kereskedési nagyságrendű ügyletek
	100,000–200,000	100,000 tCO_2e-et meghaladó és 200,000 tCO_2e-nél kisebb kereskedési nagyságrendű ügyletek
	200,000–300,000	Legalább 200,000 tCO_2e és 300,000 tCO_2e-nél kisebb kereskedési nagyságrendű ügyletek
	300,000–400,000	Legalább 300,000 tCO_2e és 400,000 tCO_2e-nél kisebb kereskedési nagyságrendű ügyletek
	[Y – Y+100,000[	Legalább Y tCO_2e és Y tCO_2e + 100,000-nél kisebb kereskedési nagyságrendű ügyletek (100,000 tCO_2e lépésköz)
	900,000–1,000,000	Legalább 900,000 tCO_2e és 1,000,000 tCO_2e-nél kisebb kereskedési nagyságrendű ügyletek
Legalább 1,000,000 és kisebb mint 10,000,000 közötti nagyságrendű ügyletek	1,000,000–1,500,000	Legalább 1,000,000 tCO_2e és 1,500,000 tCO_2e-nél kisebb kereskedési nagyságrendű ügyletek
	1,500,000–2,000,000	Legalább 1,500,000 tCO_2e és 2,000,000 tCO_2e-nél kisebb kereskedési nagyságrendű ügyletek
	[Z – Z+500,000[	Legalább Z tCO_2e és Z tCO_2e + 500,000-nél kisebb kereskedési nagyságrendű ügyletek (500,000 tCO_2e lépésköz)
	9,500,000–10,000,000	Legalább 9,500,000 tCO_2e és 10,000,000 tCO_2e-nél kisebb kereskedési nagyságrendű ügyletek
Legalább 10,000,000 és kisebb mint 100,000,000 közötti nagyságrendű ügyletek	10,000,000–15,000,000	Legalább 10,000,000 tCO_2e és 15,000,000 tCO_2e-nél kisebb kereskedési nagyságrendű ügyletek
	15,000,000–20,000,000	Legalább 15,000,000 tCO_2e és 20,000,000 tCO_2e-nél kisebb kereskedési nagyságrendű ügyletek
	[W – W+ 5,000,000[	Legalább W tCO_2e és W tCO_2e + 5,000,000-nél kisebb kereskedési nagyságrendű ügyletek (5,000,000 tCO_2e lépésköz)
	95,000,000–100,000,000	Legalább 95,000,000 tCO_2e és 100,000,000 tCO_2e-nél kisebb kereskedési nagyságrendű ügyletek
Legalább 100,000,000 nagyságrendű ügyletek	100,000,000–125,000,000	Legalább 100,000,000 tCO_2e és 125,000,000 tCO_2e-nél kisebb kereskedési nagyságrendű ügyletek
	125,000,000–150,000,000	Legalább 125,000,000 tCO_2e és 150,000,000 tCO_2e-nél kisebb kereskedési nagyságrendű ügyletek
	[X – X+25,000,000[	Legalább X tCO_2e és X tCO_2e + 25,000,000-nél kisebb kereskedési nagyságrendű ügyletek (25,000,000 tCO_2e lépésköz)
…	…	…