Šis tekstas yra skirtas tik informacijai ir teisinės galios neturi. Europos Sąjungos institucijos nėra teisiškai atsakingos už jo turinį. Autentiškos atitinkamų teisės aktų, įskaitant jų preambules, versijos skelbiamos Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje ir pateikiamos svetainėje „EUR-Lex“. Oficialūs tekstai tiesiogiai prieinami naudojantis šiame dokumente pateikiamomis nuorodomis

►B

KOMISIJOS DELEGUOTASIS REGLAMENTAS (ES) 2017/583

2016 m. liepos 14 d.

kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 dėl finansinių priemonių rinkų papildomas techniniais reguliavimo standartais, susijusiais su prekybos vietoms ir investicinėms įmonėms taikomais skaidrumo reikalavimais, susijusiais su obligacijomis, struktūrizuotais finansiniais produktais, apyvartiniais taršos leidimais ir išvestinėmis finansinėmis priemonėmis

(Tekstas svarbus EEE)

(OL L 87, 2017 3 31, p. 229)

iš dalies keičiamas:

		Oficialusis leidinys		
		Nr.	puslapis	data
►M1	2020 m. gruodžio 18 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2021/529	L 106	47	2021 3 26
►M2	2022 m. sausio 12 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2022/629	L 115I	1	2022 4 13
►M3	2023 m. sausio 17 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2023/945	L 131	17	2023 5 16
►M4	2025 m. birželio 18 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2025/1246	L 1246	1	2025 11 3

pataisytas:

►C1 Klaidų ištaisymas, OL L 90102, 2023 11 21, p. 1 (2023/945)

▼B

KOMISIJOS DELEGUOTASIS REGLAMENTAS (ES) 2017/583

2016 m. liepos 14 d.

kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 dėl finansinių priemonių rinkų papildomas techniniais reguliavimo standartais, susijusiais su prekybos vietoms ir investicinėms įmonėms taikomais skaidrumo reikalavimais, susijusiais su obligacijomis, struktūrizuotais finansiniais produktais, apyvartiniais taršos leidimais ir išvestinėmis finansinėmis priemonėmis

(Tekstas svarbus EEE)

I SKYRIUS

APIBRĖŽTYS

▼M4

1 straipsnis

Terminų apibrėžtys

Reglamento (ES) Nr. 600/2014 9 straipsnio 5 dalies f punktas

Šiame reglamente vartojamų terminų apibrėžtys:

1) centrinės ribinių pavedimų knygos prekybos sistema – bet kuri iš šių sistemų:

   a) nepertraukiamo pavedimų knygos aukciono prekybos sistema, kuri pagal pavedimų knygą ir prekybos algoritmą, kuris veikia be žmogaus įsikišimo, remdamasi geriausia turima kaina nenutrūkstamai derina pavedimus parduoti su pavedimais pirkti;

   b) prekybos sistema, apimanti nepertraukiamo pavedimų knygos aukciono prekybos sistemos elementus, kaip nurodyta a punkte, ir periodinių aukcionų prekybos sistemos elementus, kaip apibrėžta 2 punkte;

2) periodinių aukcionų prekybos sistema – prekybos sistema, kuri derina pavedimus pagal periodinį aukcioną ir prekybos algoritmą, kuris veikia be žmogaus įsikišimo.

1a straipsnis

3, 6, 8, 9, 10, 11 ir 13 straipsnių taikymo sritis

1. 3, 6, 9, 10, 11 ir 13 straipsniai taikomi tik išvestinėms finansinėms priemonėms. 8 straipsnis taikomas tik išvestinėms finansinėms priemonėms ir sudėtiniams sandoriams.

2. Šio reglamento 8 ir 11 straipsnių nuorodos į Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnį laikomos nuorodomis į Reglamento (ES) Nr. 600/2014, taikyto iki 2024 m. kovo 28 d., 11 straipsnį.

▼B

II SKYRIUS

SKAIDRUMO IKI SANDORIO SUDARYMO REIKALAVIMAI, TAIKOMI REGULIUOJAMOMS RINKOMS, DAUGIAŠALĖMS PREKYBOS SISTEMOMS IR ORGANIZUOTOS PREKYBOS SISTEMOMS

2 straipsnis

Skaidrumo iki sandorio sudarymo pareigos

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 8 straipsnio 1 ir 2 dalys)

Prekybos vietą valdantys rinkos operatoriai ir investicinės įmonės skelbia pirkimo ir pardavimo kainų intervalą ir su tomis kainomis susijusio prekybinio intereso mastą pagal jų valdomą prekybos sistemą ir I priede išdėstytus informacijos teikimo reikalavimus.

3 straipsnis

Didelės apimties pavedimai

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 9 straipsnio 1 dalies a punktas)

Pavedimas yra didelės apimties, palyginti su normaliu rinkos dydžiu, jei pateikiant pavedimą arba po bet kokio pavedimo pakeitimo jis yra lygus minimaliam pavedimo dydžiui, kuris nustatomas pagal 13 straipsnyje nurodytus metodus, arba didesnis.

▼M4

3a straipsnis

Obligacijų, struktūrizuotų finansinių produktų ir apyvartinių taršos leidimų didelės apimties pavedimai

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 9 straipsnio 1 dalies a punktas)

Obligacijų, struktūrizuotų finansinių produktų arba apyvartinių taršos leidimų pavedimas yra didelės apimties, palyginti su normaliu rinkos dydžiu, kai pavedimo įvedimo momentu arba po pavedimo pakeitimo tas pavedimas yra lygus toliau nurodytoms riboms arba už jas didesnis:

a) III priedo 2.3 lentelėje nustatytoms visų rūšių obligacijoms, išskyrus biržines prekes ir biržinius vekselius, taikomoms riboms;

b) III priedo 2.5 lentelėje nustatytoms biržinėms prekėms ir biržiniams vekseliams taikomoms riboms;

c) III priedo 3.2 lentelėje nustatytoms struktūrizuotiems finansiniams produktams taikomoms riboms;

d) III priedo 12.2 lentelėje nustatytoms apyvartiniams taršos leidimams taikomoms riboms.

▼B

4 straipsnis

Pavedimų tvarkymo sistemoje laikomų pavedimų rūšis ir minimalus dydis

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 9 straipsnio 1 dalies a punktas)

1. Prekybos vietos pavedimų tvarkymo sistemoje iki informacijos atskleidimo laikomas pavedimas, kuriam galima netaikyti skaidrumo iki sandorių sudarymo pareigų, yra pavedimas:

a) kurį ketinama atskleisti prekybos vietos naudojamoje pavedimų knygoje ir kuris priklauso nuo objektyvių sąlygų, iš anksto apibrėžtų sistemos protokole;

b) kuris iki atskleidimo prekybos vietos naudojamoje pavedimų knygoje nėra susijęs su kitu prekybiniu interesu;

c) kuris po atskleidimo prekybos vietos naudojamoje pavedimų knygoje yra susijęs su kitais pavedimais pagal tos rūšies pavedimams atskleidimo metu taikytinas taisykles.

2. Prekybos vietos pavedimų tvarkymo sistemoje iki atskleidimo laikomų pavedimų, kurių atžvilgiu galima netaikyti skaidrumo pareigų, minimalus dydis pavedimo pateikimo metu ir po bet kokio jo pakeitimo yra vienas iš šių:

a) pavedimų su rezervu atveju – 10 000 EUR arba didesnis;

b) visų kitų pavedimų atveju – lygus mažiausiam parduodamam kiekiui, nustatytam sistemos operatoriaus pagal jo taisykles ir protokolus, arba už jį didesnis.

3. 2 dalies a punkte nurodytas pavedimas su rezervu laikomas limituotu pavedimu, kurį sudaro atskleistas pavedimas, susijęs su tam tikra kiekio dalimi, ir neatskleistas pavedimas, susijęs su likusiu kiekiu, kai pavedimą dėl neatskleisto kiekio galima įvykdyti tik po to, kai informacija apie jį pavedimų knygai pateikiama kaip apie naują atskleistą pavedimą.

▼M3

4. Taikant 2 dalies a punktą, pavedimų tvarkymo sistemoje laikomų pavedimų dydis vertinamas pagal sutarčių, kuriomis prekiaujama, tariamąją sumą, kaip nurodyta II priedo 2 lentelės 10 laukelyje.

▼M4

▼B

6 straipsnis

Finansinių priemonių, kurių rinka nėra likvidi, klasės

Reglamento (ES) Nr. 600/2014 9 straipsnio 1 dalies c punktas

Laikoma, kad finansinės priemonės ar finansinių priemonių klasės rinka nėra likvidi, jei taip nustatyta remiantis 13 straipsnyje išdėstytais metodais.

▼M4

6a straipsnis

Obligacijų, struktūrizuotų finansinių produktų ir apyvartinių taršos leidimų, kurių rinka nėra likvidi, klasės

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 9 straipsnio 1 dalies c punktas)

Siekdamos nustatyti, ar obligacijų, struktūrizuotų finansinių produktų arba apyvartinių taršos leidimų rinka nėra likvidi, kompetentingos institucijos taiko šį statinį likvidumo nustatymo būdą:

a) III priedo 2.2 lentelėje nustatytą visų rūšių obligacijoms, išskyrus biržines prekes ir biržinius vekselius, taikomą nustatymo būdą;

b) III priedo 2.4 lentelėje nustatytą biržinėms prekėms ir biržiniams vekseliams taikomą nustatymo būdą;

c) III priedo 3.1 lentelėje nustatytą struktūrizuotiems finansiniams produktams taikomą nustatymo būdą;

d) III priedo 12.1 lentelėje nustatytą apyvartiniams taršos leidimams taikomą nustatymo būdą.

▼B

III SKYRIUS

SKAIDRUMO PO SANDORIO SUDARYMO REIKALAVIMAI, TAIKYTINI PREKYBOS VIETOMS IR INVESTICINĖMS ĮMONĖMS, PREKIAUJANČIOMS NE PREKYBOS VIETOJE

7 straipsnis

Skaidrumo iki sandorio sudarymo pareigos

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 10 straipsnio 1 dalis ir 21 straipsnio 1 ir 5 dalys)

1. Investicinės įmonės, prekiaujančios ne pagal prekybos vietos taisykles, ir prekybos vietą valdantys rinkos operatoriai ir investicinės įmonės paskelbia II priedo 1 ir 2 lentelėse nurodytus duomenis apie kiekvieną sandorį, naudodami visas taikytinas II priedo 3 lentelėje nurodytas žymas.

▼M4

II priedo 2 lentelėje nurodyti laukelių pavadinimai viešai skelbiami naudojant tuos pačius sutartus pavadinimus, kurie yra nurodyti tos lentelės laukelio identifikatoriuje.

▼B

2. Jei anksčiau paskelbtas prekybos pranešimas atšaukiamas, ne prekybos vietoje prekiaujančios investicinės įmonės ir prekybos vietą valdantys rinkos operatoriai ir investicinės įmonės paskelbia naują prekybos pranešimą, kuriame nurodomi visi pirminio prekybos pranešimo duomenys ir atšaukimo žyma pagal II priedo 3 lentelę.

3. Jei anksčiau paskelbtas prekybos pranešimas pakeičiamas, ne prekybos vietoje prekiaujančios įmonės bei prekybos vietą valdantys rinkos operatoriai ir investicinės įmonės paskelbia šią informaciją:

a) naują prekybos pranešimą, kuriame nurodomi visi pirminio prekybos pranešimo duomenys bei atšaukimo žyma pagal II priedo 3 lentelę;

b) naują prekybos pranešimą, kuriame nurodomi visi pirminio prekybos pranešimo duomenys, ištaisius visus reikiamus duomenis, bei pakeitimo žyma pagal II priedo 3 lentelę.

▼M4

4. Informacija po sandorio sudarymo pateikiama kuo skubiau po realaus laiko, kiek techniškai įmanoma, ir bet kokiu atveju ne vėliau nei per penkias minutes po atitinkamo sandorio įvykdymo.

_____

▼B

7. Investicinės įmonės imasi visų pagrįstų veiksmų, siekdamos užtikrinti, kad apie sandorį būtų paskelbta kaip apie vieną sandorį. Šiuo tikslu du suderinti sandoriai, vienu metu ir už tą pačią kainą sudaryti su viena šalimi tarpininke, laikomi vienu sandoriu.

▼M4

8. Su sudėtiniu sandoriu susijusi informacija apima sudėtinio sandorio žymą arba pakeitimo fiziniu turtu sandorio žymą, kaip nurodyta II priedo 3 lentelėje. Kai galima atidėti sudėtinio sandorio paskelbimą pagal 8 straipsnį, informacija apie visus jį sudarančius sandorius pateikiama pasibaigus tam sudėtiniam sandoriui nustatytam atidėjimo laikotarpiui.

▼B

8 straipsnis

Atidėtas sandorių skelbimas

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 1 ir 3 dalys ir 21 straipsnio 4 dalis)

1. Kai kompetentinga institucija leidžia atidėti sandorių duomenų paskelbimą pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 1 dalį, ne prekybos vietoje prekiaujančios investicinės įmonės, taip pat prekybos vietą valdantys rinkos operatoriai ir investicinės įmonės apie kiekvieną sandorį paskelbia ne vėliau nei antros darbo dienos po sandorio dienos 19.00 vietos laiku, jei įvykdyta bent viena iš toliau nurodytų sąlygų:

a) sandoris yra didelės apimties, palyginti su 9 straipsnyje nurodytu normaliu rinkos dydžiu;

▼B

b) sandoris yra sudarytas dėl finansinės priemonės ar finansinių priemonių klasės, kurių rinka nėra likvidi, kaip nustatyta remiantis 13 straipsnyje išdėstytais metodais;

c) sandorį vykdo investicinė įmonė, prekiaudama savo sąskaita, o ne vykdama tarpininko suderintus sandorius, kaip nurodyta Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2014/65/ES ([1]) 4 straipsnio 1 dalies 38 punkte, ir kita sandorio šalis, ir jis didesnis už 10 straipsnyje nurodytą priemonei būdingą dydį;

d) sandoris yra sudėtinis sandoris, atitinkantis vieną iš šių kriterijų:

i) viena ar kelios iš jo sudedamųjų dalių yra finansinių priemonių, kurių rinka nėra likvidi, sandoriai;

ii) viena ar kelios iš jo sudedamųjų dalių yra finansinių priemonių sandoriai, kurie yra didelės apimties, palyginti su normaliu rinkos dydžiu, nustatytu 9 straipsnyje;

iii) sandorį vykdo investicinė įmonė, prekiaudama savo sąskaita, o ne vykdydama tarpininko suderintus sandorius, kaip nurodyta Direktyvos 2014/65/ES 4 straipsnio 1 dalies 38 punkte, ir kita sandorio šalis, ir vienas ar keli iš jį sudarančių sandorių yra finansinių priemonių sandoriai, viršijantys 10 straipsnyje nurodytą priemonei būdingą dydį.

2. Kai 1 dalyje nurodytas atidėjimo terminas pasibaigia, skelbiami visi sandorio duomenys, išskyrus atvejus, kai pagal 11 straipsnį nustatomas pratęstas ar neribotas terminas.

3. Kai ne pagal prekybos vietos taisykles savo sąskaita arba klientų vardu įvykdomas dviejų investicinių įmonių sandoris, taikytiną atidėjimo tvarką nustato atitinkama investicinės įmonės, kuri įpareigota paskelbti apie sandorį per PSS pagal 7 straipsnio 5, 6 ir 7 dalis, kompetentingas institucija.

▼M4

8a straipsnis

Atidėtas obligacijų, struktūrizuotų finansinių produktų ar apyvartinių taršos leidimų sandorių informacijos skelbimas

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnis)

1. Prekybos vietą valdantys rinkos operatoriai ir investicinės įmonės, taip pat investicinės įmonės, prekiaujančios ne prekybos vietoje, gali atidėti su obligacijomis, išskyrus biržines prekes ir biržinius vekselius, susijusių sandorių duomenų paskelbimą šiomis sąlygomis:

([1]) 2014 m. gegužės 15 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2014/65/ES dėl finansinių priemonių rinkų, kuria iš dalies keičiamos Direktyva 2002/92/EB ir Direktyva 2011/61/ES (OL L 173, 2014 6 12, p. 349).

▼M4

a) III priedo 2.6 lentelėje nurodytiems 1 kategorijos sandoriams taikomas kainos ir apimties skelbimo atidėjimas ne ilgiau kaip 15 minučių;

b) III priedo 2.6 lentelėje nurodytiems 2 kategorijos sandoriams taikomas kainos ir apimties skelbimo atidėjimas ne ilgiau kaip iki prekybos dienos pabaigos;

c) III priedo 2.6 lentelėje nurodytiems 3 kategorijos sandoriams taikomas kainos skelbimo atidėjimas ne ilgiau kaip iki pirmos prekybos dienos po sandorio dienos pabaigos ir apimties skelbimo atidėjimas ne ilgiau kaip vienai savaitei po sandorio dienos;

d) III priedo 2.6 lentelėje nurodytiems 4 kategorijos sandoriams taikomas kainos skelbimo atidėjimas ne ilgiau kaip iki antrosios prekybos dienos po sandorio dienos pabaigos ir apimties skelbimo atidėjimas ne ilgiau kaip dviems savaitėms po sandorio dienos;

e) III priedo 2.6 lentelėje nurodytiems 5 kategorijos sandoriams taikomas kainos ir apimties skelbimo atidėjimas ne ilgiau kaip keturioms savaitėms po sandorio dienos.

2. Prekybos vietą valdantys rinkos operatoriai ir investicinės įmonės, taip pat investicinės įmonės, prekiaujančios ne prekybos vietoje, gali atidėti su biržinėmis prekėmis, biržiniais vekseliais ir struktūrizuotais finansiniais produktais susijusių sandorių duomenų paskelbimą šiomis sąlygomis:

a) bet kokio dydžio sandoriams taikomas kainos skelbimo atidėjimas ne ilgiau kaip iki antros prekybos dienos po sandorio dienos pabaigos ir

b) bet kokio dydžio sandoriams taikomas apimties skelbimo atidėjimas ne ilgiau kaip dviems savaitėms po sandorio dienos.

3. Prekybos vietą valdantys rinkos operatoriai ir investicinės įmonės, taip pat investicinės įmonės, prekiaujančios ne prekybos vietoje, kiekvieną su apyvartiniais taršos leidimais susijusį sandorį viešai paskelbia ne vėliau kaip iki 19.00 val. vietos laiku antrą darbo dieną po sandorio dienos, jeigu sandoris viršija III priedo 12.2 lentelėje nurodytą apyvartiniams taršos leidimams taikomą dydžio ribą po sandorio dienos.

▼B

9 straipsnis

Didelės apimties sandoriai

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 1 dalies a punktas)

Sandoris laikomas didelės apimties sandoriu, palyginti su normaliu rinkos dydžiu, jei jis lygus minimaliam sandorio dydžiui, kuris apskaičiuojamas pagal 13 straipsnyje išdėstytus metodus, arba didesnis.

▼B

10 straipsnis

Finansinei priemonei būdingas dydis

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 1 dalies c punktas)

Sandoris laikomas didesniu už finansinei priemonei būdingą dydį, jei jis lygus minimaliam sandorio dydžiui, kuris apskaičiuojamas pagal 13 straipsnyje išdėstytus metodus, arba didesnis.

11 straipsnis

Skaidrumo reikalavimai, susiję su skelbimo atidėjimu kompetentingų institucijų nuožiūra

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 3 dalis)

1. Kai kompetentingos institucijos įgyvendina savo įgaliojimus spręsti dėl leidimo atidėti paskelbimą pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 3 dalį, taikomos šios sąlygos:

a) jei taikytinas Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 3 dalies a punktas, kompetentingos institucijos pagal 8 straipsnį per visą atidėjimo laikotarpį reikalauja skelbti:

   i) visus sandorio duomenis pagal II priedo 1 ir 2 lenteles, išskyrus apimties duomenis;

   ii) sandorių dienos suvestinę, apimančią bent 5 tą pačią dieną įvykdytus sandorius ir skelbtiną kitą darbo dieną iki 9.00 vietos laiku;

b) jei taikytinas Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 3 dalies b punktas, kompetentingos institucijos leidžia neskelbti atskiro sandorio apimties per pratęstą keturių savaičių laikotarpį;

c) ne nuosavo kapitalo finansinių priemonių, kurios nėra valstybės skolos priemonės, atveju, kai taikomas Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 3 dalies c punktas, kompetentingos institucijos per pratęstą keturių savaičių laikotarpį leidžia skelbti kelių sandorių, įvykdytų per vieną kalendorinę savaitę, suvestinę kitos savaitės antradienį iki 9.00 vietos laiku.

▼M4

_____

▼B

2. Kai 1 dalies b punkte nustatytas pratęstas atidėjimo laikotarpis yra pasibaigęs, taikytini šie reikalavimai:

a) bet kokių priemonių, kurios nėra valstybės skolos priemonės, atveju visi atskirų sandorių duomenys skelbiami kitą darbo dieną iki 9.00 vietos laiku.

▼M4

_____

▼B

3. Visų priemonių, kurios nėra valstybės skolos priemonės, atveju visi atskirų sandorių duomenys skelbiami praėjus keturioms savaitėms po duomenų suvestinės paskelbimo pagal 1 dalies c punktą iki 9.00 vietos laiku.

▼M4

4. 1 ir 2 dalyse nurodomose dienos ar savaitės duomenų suvestinėse nurodoma tokia kiekvienos atitinkamo kalendorinio laikotarpio dienos ar savaitės informacija apie išvestines finansines priemones:

a) vidutinė svertinė kaina;

b) bendra prekybos apimtis, kaip nurodyta II priedo 4 lentelėje;

c) bendras sandorių skaičius.

▼B

5. Sandorių suvestinės rengiamos pagal ISIN kodą. Jei ISIN kodo nėra, sandorių suvestinės rengiamos pagal finansinių priemonių klases, kurioms taikomas 13 straipsnyje nurodytas likvidumo patikrinimas.

▼M4

6. Kai savaitės diena, kurią turėtų būti skelbiami duomenys pagal 1 dalies c punktą bei 2 ir 3 dalis, nėra darbo diena, duomenys skelbiami kitą darbo dieną iki 9.00 val. vietos laiku.

11a straipsnis

Valstybės skolos priemonėms taikomi skaidrumo reikalavimai, susiję su skelbimo atidėjimu kompetentingų institucijų nuožiūra

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 3 dalis)

1. Kelių sandorių duomenų suvestinės, kaip nurodyta Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 3 dalies b punkte, apima sandorius, kurie buvo įvykdyti per vieną kalendorinę savaitę, ir yra skelbiamos kitą antradienį iki 9.00 val. vietos laiku.

2. 1 dalyje nurodomose savaitės duomenų suvestinėse nurodoma ši kiekvienos atitinkamo kalendorinio laikotarpio savaitės informacija:

a) vidutinė svertinė kaina;

b) bendra prekybos apimtis, kaip nurodyta II priedo 4 lentelėje;

c) bendras sandorių skaičius.

3. Sandorių suvestinės rengiamos pagal ISIN kodą.

4. Kai savaitės diena, kurią turėtų būti skelbiami duomenys pagal 1 dalį, nėra darbo diena, duomenys skelbiami kitą darbo dieną iki 9.00 val. vietos laiku.

▼M3

12 straipsnis

Skaidrumo po sandorio sudarymo reikalavimų taikymas tam tikriems ne prekybos vietoje įvykdytiems sandoriams

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 21 straipsnio 1 dalis)

Reglamento (ES) Nr. 600/2014 21 straipsnio 1 dalyje nustatytos pareigos netaikomos sandoriams, išvardytiems Komisijos deleguotojo reglamento (ES) 2017/590 ([1]) 2 straipsnio 5 dalyje.

▼B

IV SKYRIUS

BENDROS SKAIDRUMO IKI SANDORIO IR PO SANDORIO SUDARYMO NUOSTATOS

13 straipsnis

Skaidrumo skaičiavimų metodai

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 9 straipsnio 1–2 dalys, 11 straipsnio 1 dalis ir 22 straipsnio 1 dalis)

1. Siekiant nustatyti finansines priemones ar finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi taikant 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, turto klasių lygmeniu taikomi toliau nurodyti metodai:

a) Statinis likvidumo vertinimas:

i) vertybiniais popieriais pakeistų išvestinių finansinių priemonių turto klasei, kaip apibrėžta III priedo 4.1 lentelėje;

ii) šiems su nuosavybės vertybiniais popieriais susietų išvestinių finansinių priemonių poklasiams: akcijų indekso pasirinkimo sandoriams, akcijų indekso ateities / išankstiniams sandoriams, akcijų pasirinkimo sandoriams, akcijų ateities / išankstiniams sandoriams, akcijų dividendų pasirinkimo sandoriams, akcijų dividendų ateities / išankstiniams sandoriams, dividendų indekso pasirinkimo sandoriams, dividendų indekso ateities / išankstiniams sandoriams, kintamumo indekso pasirinkimo sandoriams, kintamumo indekso ateities / išankstiniams sandoriams, biržinių fondų pasirinkimo sandoriams, biržinių fondų ateities / išankstiniams sandoriams ir kitoms su nuosavybės vertybiniais popieriais susietoms išvestinėms finansinėms priemonėms, kaip apibrėžta III priedo 6.1 lentelėje;

iii) užsienio valiutos finansinių išvestinių priemonių turto klasei, kaip apibrėžta III priedo 8.1 lentelėje;

▼M4

iv) kitų palūkanų normų išvestinių finansinių priemonių poklasiams, kitoms biržos prekių išvestinėms finansinėms priemonėms, kitoms kredito išvestinėms finansinėms priemonėms, kitoms C10 išvestinėms finansinėms priemonėms, kitiems sandoriams dėl kainų skirtumo ir kitoms apyvartinių taršos leidimų išvestinėms finansinėms priemonėms, kaip nurodyta III priedo 5.1, 7.1, 9.1, 10.1, 11.1 ir 13.1 lentelėse.

([1]) 2016 m. liepos 28 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/590, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 papildomas pranešimo apie sandorius kompetentingoms institucijoms techniniais reguliavimo standartais, C/2016/4733 (OL L 87, 2017 3 31, p. 449).

▼B

b) Periodinis vertinimas, pagrįstas kiekybiniais ir atitinkamais atvejais kokybiniais likvidumo kriterijais:

▼M4

_____

▼B

iii) palūkanų normų išvestinių finansinių priemonių turto poklasiui, išskyrus kitų palūkanų normų išvestinių finansinių priemonių turto poklasį, kaip apibrėžta III priedo 5.1 lentelėje;

iv) šiems su nuosavybės vertybiniais popieriais susietų išvestinių finansinių priemonių turto poklasiams: apsikeitimo sandoriams ir portfelio apsikeitimo sandoriams, kaip apibrėžta III priedo 6.1 lentelėje;

v) biržos prekių išvestinių finansinių priemonių turto poklasiui, išskyrus kitų biržos prekių išvestinių finansinių priemonių turto poklasį, kaip apibrėžta III priedo 7.1 lentelėje;

vi) šiems kredito išvestinių finansinių priemonių turto poklasiams: į indeksą įtrauktiems kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriams ir vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriams, kaip apibrėžta III priedo 9.1 lentelėje;

vii) C10 išvestinių finansinių priemonių turto poklasiui, išskyrus kitų C10 išvestinių finansinių priemonių turto poklasį, kaip apibrėžta III priedo 10.1 lentelėje;

viii) šiems sandorių dėl kainų skirtumo turto poklasiams: valiutų sandoriams dėl kainų skirtumo ir biržos prekių sandoriams dėl kainų skirtumo, kaip apibrėžta III priedo 11.1 lentelėje;

▼M4

_____

▼B

x) apyvartinių taršos leidimų išvestinių finansinių priemonių turto poklasiui, išskyrus kitų apyvartinių taršos leidimų išvestinių finansinių priemonių turto poklasį, kaip apibrėžta III priedo 13.1 lentelėje.

c) Periodinis vertinimas, pagrįstas kokybiniais likvidumo kriterijais:

i) šiems kredito išvestinių finansinių priemonių turto poklasiams: pasirinkimo sandoriams, susijusiems su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, ir vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriams, kaip apibrėžta III priedo 9.1 lentelėje;

ii) šiems sandorių dėl kainų skirtumo turto poklasiams: nuosavybės vertybinių popierių sandoriams dėl kainų skirtumo, obligacijų sandoriams dėl kainų skirtumo, sandoriams dėl kainų skirtumo, susijusiems su nuosavybės vertybinių popierių ateities / išankstiniais sandoriais, ir sandoriams dėl kainų skirtumo, susijusiems su akcijų pasirinkimo sandoriais, kaip apibrėžta III priedo 11.1 lentelėje.

▼M4

_____

▼B

2. ►M4 Siekiant nustatyti pavedimus, kurie yra didelės apimties, palyginti su 3 straipsnyje nurodytu normaliu rinkos dydžiu, taikytini šie metodai: ◄

a) ribinė vertė:

▼M4

_____

▼B

ii) vertybiniais popieriais pakeistų išvestinių finansinių priemonių turto klasei, kaip apibrėžta III priedo 4.2 lentelėje;

iii) kiekvienam su nuosavybės vertybiniais popieriais susietų išvestinių finansinių priemonių turto poklasiui, kaip apibrėžta III priedo 6.2 ir 6.3 lentelėse;

iv) kiekvienam užsienio valiutos finansinių išvestinių priemonių poklasiui, kaip apibrėžta III priedo 8.2 lentelėje;

v) kiekvienam poklasiui, kurio rinka nėra likvidi, priklausančiam palūkanų normų išvestinių finansinių priemonių, biržos prekių išvestinių finansinių priemonių, kredito išvestinių finansinių priemonių, C10 išvestinių finansinių priemonių ir sandorių dėl kainų skirtumo (SKS) turto klasėms, kaip apibrėžta III priedo 5.3, 7.3, 9.3, 10.3 ir 11.3 lentelėse;

▼M4

vi) kiekvienam turto poklasiui, kurio rinka nėra likvidi, priklausančiam apyvartinių taršos leidimų išvestinių finansinių priemonių turto klasei, kaip nurodyta III priedo 13.3 lentelėje.

_____

▼B

b) ►M4 didesnis iš šių dydžių: sandorio dydis, už kurį mažesni sandoriai sudaro sandorio procentilį atitinkančią procentinę dalį, arba minimali ribinė vertė: ◄

▼M4

_____

▼B

ii) kiekvienam poklasiui, kurio rinka likvidi, priklausančiam palūkanų normų išvestinių finansinių priemonių, biržos prekių išvestinių finansinių priemonių, kredito išvestinių finansinių priemonių, C10 išvestinių finansinių priemonių ir sandorių dėl kainų skirtumo turto klasėms, kaip apibrėžta III priedo 5.2, 7.2, 9.2, 10.2 ir 11.2 lentelėse;

▼M4

iii) kiekvienam turto poklasiui, kurio rinka yra likvidi, priklausančiam apyvartinių taršos leidimų išvestinių finansinių priemonių turto klasei, kaip nurodyta III priedo 13.2 lentelėje;

_____

▼B

3. Norint nustatyti 8 straipsnio 1 dalies c punkte nurodytą finansinei priemonei būdingą dydį bei sandorius, kurie yra didelės apimties, palyginti su 8 straipsnio 1 dalies a punkte nurodytu normaliu rinkos dydžiu, taikytini šie metodai:

a) ribinė vertė:

▼M4

_____

▼B

ii) vertybiniais popieriais pakeistų išvestinių finansinių priemonių turto klasei, kaip apibrėžta III priedo 4.2 lentelėje;

iii) kiekvienam su nuosavybės vertybiniais popieriais susietų išvestinių finansinių priemonių turto poklasiui, kaip apibrėžta III priedo 6.2 ir 6.3 lentelėse;

iv) kiekvienam užsienio valiutos finansinių išvestinių priemonių poklasiui, kaip apibrėžta III priedo 8.2 lentelėje;

v) kiekvienam poklasiui, kurio rinka nėra likvidi, priklausančiam palūkanų normų išvestinių finansinių priemonių, biržos prekių išvestinių finansinių priemonių, kredito išvestinių finansinių priemonių, C10 išvestinių finansinių priemonių ir sandorių dėl kainų skirtumo turto klasėms, kaip apibrėžta III priedo 5.3, 7.3, 9.3, 10.3 ir 11.3 lentelėse;

▼M4

vi) kiekvienam turto poklasiui, kurio rinka nėra likvidi, priklausančiam apyvartinių taršos leidimų išvestinių finansinių priemonių turto klasei, kaip nurodyta III priedo 13.3 lentelėje;

_____

_____

▼B

c) didžiausias iš šių dydžių: sandorio dydis, už kurį mažesni sandoriai sudaro sandorio procentilį atitinkančią procentinę dalį, sandorio dydis, už kurį mažesni sandoriai sudaro tokią apimties procentinę dalį, kuri atitinka apimties procentilį, ir minimali ribinė vertė, taikytina kiekvienam poklasiui, kurio rinka likvidi, priklausančiam palūkanų normų išvestinių finansinių priemonių, biržos prekių išvestinių finansinių priemonių, kredito išvestinių finansinių priemonių, C10 išvestinių finansinių priemonių ir sandorių dėl kainų skirtumo turto klasėms, kaip apibrėžta III priedo 5.2, 7.2, 9.2, 10.2 ir 11.2 lentelėse;

▼M4

d) didesnis iš šių dydžių: sandorio dydis, už kurį mažesni sandoriai sudaro sandorio procentilį atitinkančią procentinę dalį; minimali ribinė vertė kiekvienam turto poklasiui, kurio rinka nėra likvidi, priklausančiam apyvartinių taršos leidimų išvestinių finansinių priemonių turto klasei, kaip nurodyta III priedo 13.2 lentelėje.

▼B

4. Taikant 3 dalies c punktą, jei sandorio dydis, atitinkantis apimties procentilį, naudojamą nustatant sandorius, kurie yra didelės apimties, palyginti su normaliu rinkos dydžiu, yra didesnis nei 97,5 sandorio procentilis, į sandorio apimtį neatsižvelgiama, o 8 straipsnio 1 dalies c punkte nurodytas finansinei priemonei būdingas dydis bei 8 straipsnio 1 dalies a punkte nurodytas sandorio, kuris yra didelės apimties, palyginti su normaliu rinkos dydžiu, dydis yra didesnis iš šių dydžių: sandorio dydžio, už kurį mažesni sandoriai sudaro sandorio procentilį atitinkančią procentinę dalį, ir minimalios ribinės vertės.

▼B

5. Remdamosi deleguotaisiais reglamentais (ES) 2017/590 ir (ES) 2017/577, kompetentingos institucijos kasdien iš prekybos vietų, PSS ir KIJT renka duomenis, kurių reikia atliekant skaičiavimus, kad būtų nustatyti:

a) finansinės priemonės ir finansinių priemonių klasės, kurių rinka nėra likvidi, kaip nurodyta 1 dalyje;

▼M4

b) dydžiai, kurie yra didelės apimties, palyginti su normaliu rinkos dydžiu, ir priemonei būdingas dydis, kaip nurodyta 3 dalyje.

▼M3

Pirmoje pastraipoje nurodyti duomenys renkami pagal V priedą.

▼B

6. Finansinių priemonių klasei skaičiavimus atliekančios kompetentingos institucijos nustato tarpusavio bendradarbiavimo tvarką, siekdamos užtikrinti skaičiavimams reikalingų duomenų surinkimą visoje Sąjungoje.

▼M4

7. Taikydamos 1 dalies b punktą, 2 dalies b punktą ir 3 dalies c ir d punktus, kompetentingos institucijos atsižvelgia į sandorius, įvykdytus Sąjungoje praėjusių metų sausio 1 d. – gruodžio 31 d.

8. Taikant 2 dalies b punktą ir 3 dalies c ir d punktus, sandorių dydis nustatomas pagal apimties matą, kaip nurodyta II priedo 4 lentelėje. Jei sandorio dydis, nustatytas taikant 2 ir 3 dalis, yra išreikštas pinigine verte, o finansinė priemonė nėra denominuota eurais, sandorio dydis konvertuojamas į tą valiutą, kuria finansinė priemonė denominuota, taikant Europos Centrinio Banko paskelbtą orientacinį užsienio valiutos keitimo į eurus kursą, galiojusį praėjusiųjų metų gruodžio 31 d.

▼B

9. Prekybos vietą valdantys rinkos operatoriai ir investicinės įmonės gali konvertuoti pagal 2 ir 3 dalis nustatytus sandorio dydžius į atitinkamą lotų skaičių, tos prekybos vietos iš anksto nustatytą atitinkamam poklasiui ar turto poklasiui. Prekybos vietą valdantys rinkos operatoriai ir investicinės įmonės gali naudoti tokius prekybos dydžius, kol bus pradėti taikyti tolesnių pagal 17 dalį atliekamų skaičiavimų rezultatai.

▼M4

_____

11. Atliekant vertinimus, nurodytus 2 ir 3 dalyse, jei sandorių, kuriuos ketinama įtraukti į skaičiavimus, skaičius yra mažesnis nei 1 000, 2 dalies b punktas ir 3 dalies c ir d punktai netaikytini. Tokiais atvejais vietoje to taikomos 2 dalies a punkte ir 3 dalies a punkte nurodytos ribinės vertės.

▼B

12. ►M4 Išskyrus atvejus, kai skaičiavimai susiję su apyvartinių taršos leidimų išvestinėmis finansinėmis priemonėmis, atliekant straipsnio 2 dalies b punkte ir 3 dalies c punkte nurodytus skaičiavimus sumos apvalinamos iki šių artimiausių skaičių: ◄

a) 100 000, kai ribinė vertė mažesnė už 1 mln.;

b) 500 000, kai ribinė vertė lygi 1 mln. arba didesnė, bet mažesnė už 10 mln.;

c) 5 mln., kai ribinė vertė lygi 10 mln. arba didesnė, bet mažesnė už 100 mln.;

d) 25 mln., kai ribinė vertė lygi 100 mln. arba didesnė.

13. Taikant 1 dalį, III priede kiekvienai turto klasei nurodyti kiekybiniai likvidumo kriterijai nustatomi remiantis III priedo 1 skirsniu.

▼M4

14. Su nuosavybės vertybiniais popieriais susietų išvestinių finansinių priemonių, kuriomis leidžiama prekiauti ar pirmą kartą prekiaujama prekybos vietoje, kurios nepriklauso poklasiui, kurio atžvilgiu paskelbtas 8 straipsnio 1 dalies c punkte nurodytas finansinei priemonei būdingas dydis ir didelės apimties, palyginti su 3 straipsnyje ir 8 straipsnio 1 dalies a punkte nurodytu normaliu rinkos dydžiu, pavedimų bei sandorių dydis, ir kurios priklauso vienam iš 1 dalies a punkto ii papunktyje nurodytų turto poklasių, atveju finansinei priemonei būdingas dydis ir didelės apimties, palyginti su normaliu rinkos dydžiu, pavedimų bei sandorių dydis yra lygūs dydžiams, taikytiniems turto poklasio, kuriam priklauso su nuosavybės vertybiniais popieriais susieta išvestinė finansinė priemonė, mažiausiam dienos tariamosios sumos vidurkio intervalui.

15. Finansinės priemonės, kuriomis leidžiama prekiauti ar pirmą kartą prekiaujama prekybos vietoje, kurios nepriklauso poklasiui, kurio atžvilgiu paskelbtas 8 straipsnio 1 dalies c punkte nurodytas finansinei priemonei būdingas dydis ir didelės apimties, palyginti su 3 straipsnyje ir 8 straipsnio 1 dalies a punkte nurodytu normaliu rinkos dydžiu, pavedimų bei sandorių dydis, laikomos neturinčiomis likvidžios rinkos tol, kol bus pradėti taikyti pagal 17 dalį atliktų skaičiavimų rezultatai. Taikytinas 8 straipsnio 1 dalies c punkte nurodytas finansinei priemonei būdingas dydis ir didelės apimties, palyginti su 3 straipsnyje ir 8 straipsnio 1 dalies a punkte nurodytu normaliu rinkos dydžiu, pavedimų bei sandorių dydis yra lygūs poklasių, priklausančių tam pačiam turto poklasiui, kurių rinka nėra likvidi, dydžiams.

▼B

16. Pasibaigus prekybos dienai, bet nepasibaigus parai, prekybos vietos kiekvienu atveju, kai finansine priemone leidžiama prekiauti ar pirmą kartą prekiaujama toje prekybos vietoje arba kai anksčiau pateikti duomenys pasikeičia, kompetentingoms institucijoms pateikia į IV priedą įtrauktus duomenis 5 dalyje nurodytiems skaičiavimams atlikti.

▼M3

17. Kompetentingos institucijos užtikrina, kad 5 dalyje nurodytų skaičiavimų rezultatai kiekvienos finansinės priemonės ir finansinių priemonių klasės atžvilgiu būtų paskelbti iki metų, kurie eina po Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios dienos, balandžio 30 d. ir iki kiekvienų vėlesnių metų balandžio 30 d. Skaičiavimų rezultatai taikomi nuo kiekvienų metų birželio mėn. pirmojo pirmadienio po jų paskelbimo iki dienos, einančios prieš kitų metų birželio mėn. pirmąjį pirmadienį.

▼M4

_____

▼B

14 straipsnis

Sandoriai, kuriems taikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 1 straipsnio 6 dalyje numatyta išimtis

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 1 straipsnio 6 dalis)

Laikoma, kad sandorį sudarė Europos centrinių bankų sistemos (ECBS) narys, įgyvendindamas pinigų, užsienio valiutos ir finansinio stabilumo politiką, kai sandoris atitinka bet kurį iš toliau išdėstytų reikalavimų:

a) sandoris vykdomas įgyvendinant pinigų politiką, įskaitant operacijas, vykdomas pagal Europos centrinių bankų sistemos ir Europos Centrinio Banko statuto, kuris sudaro Europos Sąjungos Sutarties priedą, 18 ir 20 straipsnius, arba operacijas, vykdomas pagal atitinkamas nacionalines nuostatas dėl Europos centrinių bankų sistemos (ECBS) narių valstybėse narėse, kurių valiuta nėra euro;

b) sandoris yra užsienio valiutos keitimo operacija, įskaitant operacijas, vykdomas saugant ar valdant valstybių narių užsienio atsargas, arba atsargų valdymo paslaugą, ECBS nario teikiamą kitų valstybių centriniams bankams, kuriems taikoma išimtis pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 1 straipsnio 9 dalį;

c) sandoris vykdomas siekiant finansų stabilumo politikos tikslų.

15 straipsnis

Sandoriai, kuriems netaikoma Reglamento (ES) Nr. 600/2014 1 straipsnio 6 dalyje numatyta išimtis

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 1 straipsnio 7 dalis)

Reglamento (ES) Nr. 600/2014 1 straipsnio 6 dalis netaikoma toliau nurodytų rūšių sandoriams, kuriuos ECBS narys sudarė vykdydamas investavimo operaciją, nesusijusią su šio nario veikla įgyvendinant vieną iš 14 straipsnyje nurodytų uždavinių:

a) sandoriams, sudarytiems dėl jo nuosavų lėšų valdymo;

▼B

b) sandoriams, sudarytiems administraciniais tikslais arba ECBS nario darbuotojų naudai, įskaitant sandorius, vykdomus einant jo darbuotojų pensijų sistemos administratoriaus pareigas;

c) sandoriams dėl jo investicijų portfelio, sudarytiems pagal nacionalinėje teisėje nustatytas prievoles.

▼M4

16 straipsnis

Laikinas skaidrumo pareigų taikymo sustabdymas

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 9 straipsnio 4 dalis)

1. Finansinių priemonių, kurių rinka yra likvidi, kaip nustatyta taikant 6a straipsnyje nustatytus obligacijoms, struktūrizuotiems finansiniams produktams ir apyvartiniams taršos leidimams taikomus metodus ir 13 straipsnyje nustatytus išvestinėms finansinėms priemonėms taikomus metodus, atžvilgiu kompetentingos institucijos gali laikinai sustabdyti Reglamento (ES) Nr. 600/2014 8, 8a ir 10 straipsniuose nurodytų pareigų taikymą, kai tam tikros klasės obligacijų, struktūrizuotų finansinių produktų, apyvartinių taršos leidimų ar išvestinių finansinių priemonių bendra apimtis, kaip nurodyta II priedo 4 lentelėje, per pastarąsias 30 kalendorinių dienų sudarė mažiau nei 40 % mėnesio apimties vidurkio, apskaičiuoto pagal 12 visos trukmės kalendorinių mėnesių, ėjusių prieš tas 30 kalendorinių dienų.

2. Finansinių priemonių, kurių rinka nėra likvidi, kaip nustatyta taikant 6a straipsnyje nustatytus obligacijoms, struktūrizuotiems finansiniams produktams ir apyvartiniams taršos leidimams taikomus metodus ir 13 straipsnyje nustatytus išvestinėms finansinėms priemonėms taikomus metodus, atžvilgiu kompetentingos institucijos gali laikinai sustabdyti Reglamento (ES) Nr. 600/2014 8, 8a ir 10 straipsniuose nurodytų pareigų taikymą, kai tam tikros klasės obligacijų, struktūrizuotų finansinių produktų, apyvartinių taršos leidimų ar išvestinių finansinių priemonių bendra apimtis, kaip nurodyta II priedo 4 lentelėje, per pastarąsias 30 kalendorinių dienų sudarė mažiau nei 20 % mėnesio apimties vidurkio, apskaičiuoto pagal 12 visos trukmės kalendorinių mėnesių, ėjusių prieš tas 30 kalendorinių dienų.

3. Atlikdamos 1 ir 2 dalyse nurodytus skaičiavimus, kompetentingos institucijos atsižvelgia į atitinkamos klasės obligacijų, struktūrizuotų finansinių produktų, apyvartinių taršos leidimų ar išvestinių finansinių priemonių sandorius, įvykdytus visose Sąjungos prekybos vietose. Kompetentingos institucijos tuos skaičiavimus atlieka pagal finansinių priemonių klases, kurioms taikomas 6a straipsnyje (obligacijų, struktūrizuotų finansinių produktų ir apyvartinių taršos leidimų atveju) ir 13 straipsnyje (išvestinių finansinių priemonių atveju) nurodytas likvidumo patikrinimas.

4. Prieš sustabdydamos skaidrumo pareigų taikymą kompetentingos institucijos įsitikina, kad smarkų likvidumo sumažėjimą prekybos vietose lėmė ne atitinkamos klasės finansinių priemonių sezoniškumo įtaka likvidumui.

▼B

19 straipsnis

Įsigaliojimas ir taikymas

Šis reglamentas įsigalioja dvidešimtą dieną po jo paskelbimo *Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje*.

Jis taikomas nuo 2017 m. sausio 3 d. Tačiau 18 straipsnis taikomas nuo šio reglamento įsigaliojimo dienos.

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.

▼**M4**

I PRIEDAS

Sistemų rūšys ir susijusi informacija, skelbtina viešai pagal 2 straipsnį

Sistemos rūšis	Viešai skelbtina informacija
Nepertraukiamo pavedimų knygos aukciono prekybos sistema	Kiekvienos finansinės priemonės atžvilgiu – bendras pavedimų skaičius ir atitinkama jų apimtis pagal kiekvieną kainos lygį, nurodant ne mažiau kaip penkis geriausios pirkimo ir pardavimo kainos lygius.
Periodinių aukcionų prekybos sistema	Kiekvienos finansinės priemonės atžvilgiu – kaina, pagal kurią aukciono prekybos sistema geriausiai atitiktų savo prekybos algoritmą, ir apimtis, kurią tos sistemos dalyviai galėtų įvykdyti ta kaina.

▼B

II PRIEDAS

Viešai skelbtini sandorių duomenys

1 lentelė

2 lentelės simbolių lentelė

SIMBOLIS	DUOMENŲ RŪŠIS	APIBRĖŽTIS
{ALPHANUM-n}	Iki n raidinių skaitinių ženklų	Laukelyje pateikiamas laisvo pobūdžio tekstas.
{CURRENCYCODE_3}	3 raidiniai skaitiniai ženklai	Triraidis ISO 4217 valiutos kodas.
{DATE_TIME_FORMAT}	ISO 8601 datos ir laiko formatas	Data ir laikas šiuo formatu: YYYY-MM-DDThh:mm:ss.dddddd**Z**, kai: — YYYY – metai; — MM – mėnuo; — DD – diena; — T – reikia įrašyti raidę T; — hh – valanda; — mm – minutė; — ss.dddddd – sekundė ir sekundės dalis; — Z – suderintasis pasaulinis laikas.Datos ir laikai pateikiami suderintuoju pasauliniu laiku (UTC).
{DECIMAL-n/m}	Dešimtainis skaičius iš viso iki n skaitmenų, iš kurių iki m skaitmenų gali rodyti dalis	Skaitiniame laukelyje įrašomos ir teigiamos, ir neigiamos vertės: — dešimtainės trupmenos skiriamos „.“ (tašku); — neigiami skaičiai nurodomi su „–“ (minusu); Atitinkamais atvejais vertės apvalinamos, o ne trumpinamos.
{ISIN}	12 raidinių skaitinių ženklų	ISIN kodas pagal ISO 6166.
{MIC}	4 raidiniai skaitiniai ženklai	Rinkos identifikatorius pagal ISO 10383.

▼M4

2 lentelė

Duomenų, teiktinų skaidrumo po sandorio sudarymo tikslu, sąrašas

Skelbiami laukelių pavadinimai (skilties antraštės) turi sutapti su 2 lentelėje pateiktu laukelio identifikatoriumi

#	Laukelio identifikatorius	Finansinės priemonės	Aprašymas ir skelbtina informacija	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Pagal 1 lentelės nurodymus pildoma forma
1.	Prekybos data ir laikas	Visoms finansinėms priemonėms	Data ir laikas, kada buvo įvykdytas sandoris. Prekybos vietoje įvykdytų sandorių atveju detalumo lygis turi atitikti reikalavimus, nustatytus Komisijos deleguotojo reglamento (ES) 2025/1155 ([1]) 12 straipsnyje. Ne prekybos vietoje įvykdytų sandorių atveju data ir laikas, kai šalys susitaria dėl verčių šiuose laukeliuose: kiekis, kaina, valiuta, kaip nurodyta Deleguotojo reglamento (ES) 2017/590 I priedo 2 lentelės 31, 34 ir 44 laukeliuose; priemonės identifikavimo kodas, priemonės klasifikacija ir pagrindinės priemonės kodas, kai yra. Ne prekybos vietoje įvykdytų sandorių atveju laikas nurodomas bent sekundės tikslumu. Jei sandoris sudarytas vykdančiajai įmonei kliento vardu perdavus trečiajai šaliai pavedimą, kai Deleguotojo reglamento (ES) 2017/590 4 straipsnyje nustatytos perdavimo sąlygos neįvykdytos, nurodoma sandorio data ir laikas, o ne pavedimo perdavimo laikas.	Reguliuojama rinka (RM) Daugiašalė prekybos sistema (MTF) Organizuotos prekybos sistema (OTF) Patvirtintas skelbimo subjektas (APA)	{DATE_TIME_ FORMAT}
2.	Priemonės identifikavimo kodas	Visoms finansinėms priemonėms	Finansinei priemonei identifikuoti naudojamas kodas	RM, MTF, OTF, APA	{ISIN}

▼M4

#	Laukelio identifikatorius	Finansinės priemonės	Aprašymas ir skelbtina informacija	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Pagal 1 lentelės nurodymus pildoma forma
3.	Kaina	Visoms finansinėms priemonėms	Sandorio vykdymo kaina be komisinių ir sukauptų palūkanų (jei taikytina). Sandorio vykdymo kaina nurodoma vadovaujantis standartine rinkos tvarka. Šiame laukelyje nurodyta vertė turi atitikti laukelyje „Kainos žymėjimas“ nurodytą vertę. Jei kaina šiuo metu nežinoma, tačiau netrukus bus žinoma, („PNDG“) arba yra netaikoma („NOAP“), šis laukelis nepildomas.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/13} – jei kaina išreikšta pinigine verte; {DECIMAL-11/10} – jei kaina išreikšta procentine dalimi arba pajamingumu; {DECIMAL-18/17} – jei kaina išreikšta baziniais punktais.
4.	Nenurodyta kaina	Visoms finansinėms priemonėms	Jei kaina šiuo metu nežinoma, tačiau netrukus bus žinoma, įrašoma vertė „PNDG“. Jei kaina netaikoma, įrašoma vertė „NOAP“.	RM, MTF, OTF, APA	PNDG – jei kaina nežinoma; NOAP – jei kaina netaikoma.
5.	Kainos valiuta	Visoms finansinėms priemonėms	Pagrindinė valiuta, kuria išreikšta kaina (taikoma, jei kaina išreikšta pinigine verte).	RM, MTF, OTF, APA	{CURRENCY CODE_3}
6.	Kainos žymėjimas	Visoms finansinėms priemonėms	Nurodyti, ar kaina išreikšta pinigine verte, procentine dalimi, baziniais punktais ar pajamingumu. Kainos žymėjimas nurodomas vadovaujantis standartine rinkos tvarka. Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių atveju į šį laukelį įrašoma „BAPO“. Obligacijų (išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas) atveju šiame laukelyje nurodoma tariamosios sumos procentinė dalis (PERC). Jei kainos nurodymas procentine dalimi nėra standartinė rinkos tvarka, į šį laukelį įrašoma „YIEL“, „BAPO“ arba „MONE“ vadovaujantis standartine rinkos tvarka. Šiame laukelyje nurodyta vertė turi atitikti laukelyje „Kaina“ nurodytą vertę. Jei kaina nurodoma pinigine išraiška, ji turi būti nurodyta pagrindinės valiutos vienetu.	RM, MTF, OTF, APA	MONE – piniginė vertė PERC – procentinė dalis YIEL – pajamingumas BAPO – baziniai punktai

▼M4

#	Laukelio identifikatorius	Finansinės priemonės	Aprašymas ir skelbtina informacija	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Pagal 1 lentelės nurodymus pildoma forma
			Jei kaina šiuo metu nežinoma, tačiau netrukus bus žinoma, („PNDG“) arba yra netaikoma („NOAP“), šis laukelis nepildomas.		
7.	Kiekis	Visoms finansinėms priemonėms, išskyrus šio reglamento 11 straipsnio 1 dalies a ir b punktuose nurodytus atvejus	Finansinių priemonių, kuriomis prekiaujama vienetais, atveju – finansinės priemonės vienetų skaičius. Kitais atvejais laukelis paliekamas tuščias.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL- 18/17}
8.	Kiekis matavimo vienetais	Vienetais išreikštoms sutartims, kaip antai biržos prekių išvestinėms finansinėms priemonėms, C10 išvestinėms finansinėms priemonėms, apyvartinių taršos leidimų išvestinėms finansinėms priemonėms ir apyvartiniams taršos leidimams, išskyrus šio reglamento 11 straipsnio 1 dalies a ir b punktuose nurodytus atvejus	Atitinkamas parduodamų biržos prekių arba apyvartinių taršos leidimų kiekis matavimo vienetais	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL- 18/17}
9.	Kiekio žymėjimas matavimo vienetais	Vienetais išreikštoms sutartims, kaip antai biržos prekių išvestinėms finansinėms priemonėms, C10 išvestinėms finansinėms priemonėms, apyvartinių taršos leidimų išvestinėms finansinėms priemonėms ir apyvartiniams taršos leidimams, išskyrus šio reglamento 11 straipsnio 1 dalies a ir b punktuose nurodytus atvejus	Nurodoma, kaip žymimi matavimo vienetai, kuriais išreikštas kiekis.	RM, MTF, OTF, APA	TOCD – tonos anglies dioksido ekvivalento pagal bet kokią sutartį, susijusią su apyvartiniais taršos leidimais TONE – metrinės tonos MWHO – megavatvalandės MBTU – milijonas britų terminių vienetų THMS – termai DAYS – dienos arba {ALPHANUM-4} kitu atveju

▼M4

#	Laukelio identifikatorius	Finansinės priemonės	Aprašymas ir skelbtina informacija	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Pagal 1 lentelės nurodymus pildoma forma
10.	Tariamoji suma	Visoms finansinėms priemonėms, išskyrus šio reglamento 11 straipsnio 1 dalies a ir b punktuose nurodytus atvejus	Šiame laukelyje nurodoma: i) obligacijų (išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas) atveju – nominalioji vertė, t. y. išpirkimo metu investuotojui grąžinama suma; ii) biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijų atveju – priemonių, kuriomis apsikeista tarp pirkėjų ir pardavėjų, skaičius, padaugintas iš priemonės, kuria apsikeista sudarant tą konkretų sandorį, kainos. Atitinkamai – kainos laukelio vertė padauginama iš kiekio laukelio vertės; iii) struktūrizuotų finansinių produktų (SFP) atveju – vieneto nominalioji vertė, padauginta iš priemonių skaičiaus sandorio sudarymo metu; iv) kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių atveju – tariamoji suma, kurios atžvilgiu įgyjama arba perleidžiama apsauga; v) pasirinkimo sandorių, pasirinkimo sandorių dėl apsikeitimo sandorių, kitų nei nurodyti iv punkte apsikeitimo sandorių, ateities sandorių ir išankstinių sandorių atveju – tariamoji sutarties suma; vi) apyvartinių taršos leidimų atveju – gautas kiekis už atitinkamą kainą, nustatytą sutartyje sandorio sudarymo metu. Atitinkamai – kainos laukelio vertė padauginama iš matavimo vieneto laukelyje nurodyto kiekio; vii) kainų skirtumo lažybų sandorių atveju – piniginė vertė sandorio sudarymo metu, kuria lažinamasi, pagrindinės finansinės priemonės vieno punkto pokyčiui;	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/5}

▼M4

#	Laukelio identifikatorius	Finansinės priemonės	Aprašymas ir skelbtina informacija	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Pagal 1 lentelės nurodymus pildoma forma
			viii) sandorių dėl kainų skirtumo atveju – priemonių, kuriomis apsikeista tarp pirkėjų ir pardavėjų, skaičius, padaugintas iš priemonės, kuria apsikeista sudarant konkretų sandorį, kainos. Atitinkamai – kainos laukelio vertė padauginama iš kiekio laukelio vertės.		
11.	Tariamosios sumos valiuta	Visoms finansinėms priemonėms, išskyrus šio reglamento 11 straipsnio 1 dalies a ir b punktuose nurodytus atvejus	Pagrindinė valiuta, kuria išreikšta tariamoji suma. Užsienio valiutos išvestinių finansinių priemonių sandorio arba apsikeitimo keliomis valiutomis sandorio arba pasirinkimo sandorio dėl apsikeitimo sandorio, kai pagrindinis apsikeitimo sandoris vykdomas keliomis valiutomis arba kai jis yra valiutos sandoris dėl kainų skirtumo ar kainų skirtumų lažybų sandoris, atveju nurodoma 1 sandorio dalies tariamosios sumos valiuta.	RM, MTF, OTF, APA	{CURRENCY CODE_3}
12.	[išbraukta]				
13.	Vykdymo vieta	Visoms finansinėms priemonėms	Vietos, kurioje buvo įvykdytas sandoris, nuoroda. ES prekybos vietoje įvykdytiems sandoriams naudoti ISO 10383 segmento MIC kodą. Jei segmento MIC kodas neegzistuoja, naudoti veiklos MIC kodą. Finansinėms priemonėms, kuriomis leidžiama prekiauti arba prekiaujama prekybos vietoje, kai tos finansinės priemonės sandoris įvykdytas per sistemingai sandorius savo viduje sudarantį tarpininką, naudoti kodą „SINT“. Finansinėms priemonėms, kuriomis leidžiama prekiauti arba prekiaujama prekybos vietoje, kai tos finansinės priemonės sandoris įvykdytas ne ES prekybos vietoje ir ne sistemingai sandorius savo viduje sudarančio tarpininko, naudoti MIC kodą „XOFF“. Jei sandoris vykdomas organizuotoje prekybos platformoje už ES ribų, reikia nurodyti ne tik „XOFF“, bet ir užpildyti laukelį „Trečiosios valstybės prekybos vieta, kurioje vykdomas sandoris“.	RM, MTF, OTF, APA	{MIC} – ES prekybos vietos arba SINT – sistemingai sandorius savo viduje sudarantis tarpininkas XOFF – kitais atvejais

▼M4

#	Laukelio identifikatorius	Finansinės priemonės	Aprašymas ir skelbtina informacija	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Pagal 1 lentelės nurodymus pildoma forma
14.	Trečiosios valstybės prekybos vieta, kurioje vykdomas sandoris	Visoms finansinėms priemonėms	Trečiosios valstybės prekybos vietos, kurioje buvo įvykdytas sandoris, nuoroda. Naudoti ISO 10383 segmento MIC kodą. Jei segmento MIC kodas neegzistuoja, naudoti veiklos MIC kodą. Kai sandoris nėra vykdomas trečiosios valstybės prekybos vietoje, laukelis nepildomas.	APA	{MIC}
15.	Paskelbimo data ir laikas	Visoms finansinėms priemonėms	Data ir laikas, kada prekybos vieta arba patvirtintas skelbimo subjektas paskelbė sandorį. Prekybos vietoje įvykdytų sandorių atveju detalumo lygis turi atitikti reikalavimus, nustatytus Deleguotojo reglamento (ES) 2025/1155 12 straipsnyje. Ne prekybos vietoje įvykdytų sandorių atveju laikas nurodomas bent sekundės tikslumu.	RM, MTF, OTF, APA	{DATE_TIME_ FORMAT}
16	Paskelbimo vieta	Visoms finansinėms priemonėms	Sandorį skelbiančios prekybos vietos ir patvirtinto skelbimo subjekto identifikavimo kodas	RM, MTF, OTF, APA	{MIC}
17	Sandorio identifikavimo kodas	Visoms finansinėms priemonėms	Raidinis skaitinis kodas, kurį priskiria prekybos vietos (pagal Komisijos deleguotojo reglamento (ES) 2017/580 ([2]) 12 straipsnį) ir patvirtintas skelbimo subjektas ir kuris naudojamas visose vėlesnėse nuorodose į konkretų sandorį.	RM, MTF, OTF, APA	{ALPHA NUMERICAL-52}
18.	Tarpuskaitiniai sandoriai	Išvestinėms finansinėms priemonėms	Kodas, parodantis, ar sandorio tarpuskaita bus atlikta.	RM, MTF, OTF, APA	TRUE – sandorio tarpuskaita turi būti atlikta FALSE – sandorio tarpuskaita neturi būti atlikta

▼M4

#	Laukelio identifikatorius	Finansinės priemonės	Aprašymas ir skelbtina informacija	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Pagal 1 lentelės nurodymus pildoma forma
19.	Žymos	Visoms finansinėms priemonėms	Į vieną ar kelis laukelius reikėtų įrašyti atitinkamas žymas, aprašytas II priedo 3 lentelėje. Jeigu nė viena iš nurodytų aplinkybių netinka, sandoris turėtų būti skelbiamas be žymos. Kai galimas ir viename laukelyje pateikiamas žymų derinys, nurodomas žymas reikėtų atskirti kableliais.	RM, MTF, OTF, APA	Kaip nustatyta II priedo 3 lentelėje
20.	Prekybos sistema	Visoms finansinėms priemonėms	Prekybos sistemos, kurioje įvykdytas sandoris, rūšis. Kai į laukelį „Vykdymo vieta“ įrašomas kodas SINT arba XOFF, šis laukelis nepildomas.	RM, MTF, OTF	CLOB – centrinės ribinių pavedimų knygos prekybos sistema QDTS – kotiravimu pagrįsta prekybos sistema, t. y. sistema, kurioje sandoriai vykdomi remiantis tvirtosiomis kotiruotėmis, kurios nepertraukiamai skelbiamos dalyviams; kurioje rinkos formuotojai turi išlaikyti kotiruotes tokio lygio, kad būtų subalansuoti narių ir dalyvių poreikiai atlikti komercinės apimties sandorius ir rinkos formuotojams kylanti rizika PATS – periodinių aukcionų prekybos sistema RFQT – prašymų dėl kotiruočių prekybos sistema, kurioje kotiruotė arba kotiruotės pateikiamos reaguojant į vieno arba kelių kitų narių ar dalyvių pateiktą prašymą dėl kotiruotės. Pasinaudoti kotiruote gali tik prašymą pateikęs narys ar rinkos dalyvis. Prašymą pateikęs narys ar dalyvis gali sudaryti sandorį, sutikdamas su kotiruote (-ėmis), kuri (-ios) jam pateikta (-os) jo prašymu.

▼M4

#	Laukelio identifikatorius	Finansinės priemonės	Aprašymas ir skelbtina informacija	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Pagal 1 lentelės nurodymus pildoma forma
					VOIC – žodinės prekybos sistema, t. y. prekybos sistema, kurioje derybos dėl narių sandorių vyksta žodžiu HYBR – hibridinė prekybos sistema, t. y. sistema, apimanti dviejų ar daugiau rūšių prekybos sistemas iš pirmiau nurodytųjų OTHR – bet kuri kita prekybos sistema, t. y. bet kurios kitos pirmiau nenurodytos rūšies prekybos sistema
21.	Sandorių skaičius	Valstybės skolos priemonėms	Į šį laukelį reikėtų įrašyti įvykdytų sandorių skaičių, kai pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 3 dalies b punktą privalomas atidėtas suvestinių kelių sandorių duomenų skelbimas.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/17}

([1]) 2025 m. birželio 12 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2025/1155 kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 papildomas techniniais reguliavimo standartais, kuriais nustatomi konsoliduotos informacinės juostos įvesties ir išvesties duomenys, verslo laikrodžių sinchronizavimas ir akcijų bei biržinių fondų konsoliduotos informacinės juostos teikėjo atliekamas pajamų perskirstymas, ir panaikinamas Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/574 (OL L, 2025/1155, 2025 11 3, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2025/1155/oj).

([2]) 2016 m. birželio 24 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/580, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 papildomas finansinių priemonių pavedimų atitinkamų duomenų laikymo techniniais reguliavimo standartais, (OL L 87, 2017 3 31, p. 193, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/580/oj).

▼M4

3 lentelė

Žymų sąrašas skaidrumo po sandorio sudarymo tikslais

IŠVESTINIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ DUOMENŲ SKELBIMO PO SANDORIO SUDARYMO ATIDĖJIMO ŽYMOS			
Žyma	Pavadinimas	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Aprašymas
LRGS	Didelės apimties sandorio po sandorio sudarymo žyma	RM, MTF, OTF, APA	Įvykdyti sandoriai, kurių paskelbimas po sandorio sudarymo atidedamas dėl didelės apimties
ILQD	Nelikvidžių priemonių sandorio žyma	RM, MTF, OTF, APA	Sandoriai su likvidžios rinkos neturinčiomis priemonėmis, kurių paskelbimas atidėtas
SIZE	Sandorių taikant priemonei būdingą dydį po sandorio sudarymo žyma	RM, MTF, OTF, APA	Įvykdyti sandoriai, kurių paskelbimas po sandorio sudarymo atidedamas dėl priemonei būdingo dydžio

OBLIGACIJŲ (IŠSKYRUS BIRŽINIŲ PREKIŲ IR BIRŽINIŲ VEKSELIŲ OBLIGACIJAS) DUOMENŲ SKELBIMO PO SANDORIO SUDARYMO ATIDĖJIMO ŽYMOS			
Žyma	Pavadinimas	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Aprašymas
MLF1	Likvidžių vidutinio dydžio sandorių žyma	RM, MTF, OTF, APA	Obligacijų sandoriai, kuriems taikomas duomenų skelbimo atidėjimas pagal šio reglamento 8a straipsnio 1 dalies a punktą, skirtas vidutinio dydžio sandoriams finansine priemone, kurios rinka yra likvidi.
MIF2	Nelikvidžių vidutinio dydžio sandorių žyma	RM, MTF, OTF, APA	Obligacijų sandoriai, kuriems taikomas duomenų skelbimo atidėjimas pagal šio reglamento 8a straipsnio 1 dalies b punktą, skirtas vidutinio dydžio sandoriams finansine priemone, kurios rinka nėra likvidi.
LLF3	Likvidžių didelio dydžio sandorių žyma	RM, MTF, OTF, APA	Obligacijų sandoriai, kuriems taikomas duomenų skelbimo atidėjimas pagal šio reglamento 8a straipsnio 1 dalies c punktą, skirtas didelio dydžio sandoriams finansine priemone, kurios rinka yra likvidi.
LIF4	Nelikvidžių didelio dydžio sandorių žyma	RM, MTF, OTF, APA	Obligacijų sandoriai, kuriems taikomas duomenų skelbimo atidėjimas pagal šio reglamento 8a straipsnio 1 dalies d punktą, skirtas didelio dydžio sandoriams finansine priemone, kurios rinka nėra likvidi.

▼M4

OBLIGACIJŲ (IŠSKYRUS BIRŽINIŲ PREKIŲ IR BIRŽINIŲ VEKSELIŲ OBLIGACIJAS) DUOMENŲ SKELBIMO PO SANDORIO SUDARYMO ATIDĖJIMO ŽYMOS

Žyma	Pavadinimas	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Aprašymas
VLF5	Likvidžių labai didelio dydžio sandorių žyma	RM, MTF, OTF, APA	Obligacijų sandoriai, kuriems taikomas duomenų skelbimo atidėjimas pagal šio reglamento 8a straipsnio 1 dalies e punktą, skirtas labai didelio dydžio sandoriams finansine priemone, kurios rinka yra likvidi.
VIF5	Nelikvidžių labai didelio dydžio sandorių žyma	RM, MTF, OTF, APA	Obligacijų sandoriai, kuriems taikomas duomenų skelbimo atidėjimas pagal šio reglamento 8a straipsnio 1 dalies e punktą, skirtas labai didelio dydžio sandoriams finansine priemone, kurios rinka nėra likvidi.

BIRŽINIŲ PREKIŲ, BIRŽINIŲ VEKSELIŲ, STRUKTŪRIZUOTŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ IR APYVARTINIŲ TARŠOS LEIDIMŲ DUOMENŲ SKELBIMO PO SANDORIO SUDARYMO ATIDĖJIMO ŽYMOS

Žyma	Pavadinimas	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Aprašymas
DEFF	Biržinių prekių, biržinių vekselių, struktūrizuotų finansinių priemonių ir apyvartinių taršos leidimų duomenų skelbimo atidėjimas	RM, MTF, OTF, APA	Biržinių prekių, biržinių vekselių, struktūrizuotų finansinių priemonių ir apyvartinių taršos leidimų sandoriai, kuriems taikomas atidėjimas, nurodytas šio reglamento 8a straipsnio 2 ir 3 dalyse.

PAPILDOMOS IŠVESTINIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ DUOMENŲ ATIDĖJIMO ŽYMOS

11 straipsnio 1 dalies a punkto i papunktis	LMTF	Ribotų duomenų žyma	RM, MTF, OTF, APA	Pirmasis pranešimas, paskelbiant ribotus duomenis pagal 11 straipsnio 1 dalies a punkto i papunktį.
	FULF	Išsamių duomenų žyma	RM, MTF, OTF, APA	Sandoriai, kurių riboti duomenys jau buvo paskelbti pagal 11 straipsnio 1 dalies a punkto i papunktį.
11 straipsnio 1 dalies a punkto ii papunktis	DATF	Sandorių dienos suvestinės žyma	RM, MTF, OTF, APA	Dienos sandorių suvestinės skelbimas pagal 11 straipsnio 1 dalies a punkto ii papunktį.
	FULA	Išsamių duomenų žyma	RM, MTF, OTF, APA	Atskiri sandoriai, kurių duomenų suvestinės jau buvo paskelbtos pagal 11 straipsnio 1 dalies a punkto ii papunktį.

▼M4

PAPILDOMOS IŠVESTINIŲ FINANSINIŲ PRIEMONIŲ DUOMENŲ ATIDĖJIMO ŽYMOS				
11 straipsnio 1 dalies b punktas	VOLO	Neskelbiamos apimties žyma	RM, MTF, OTF, APA	Sandoriai, kurių riboti duomenys skelbiami pagal 11 straipsnio 1 dalies b punktą.
	FULV	Išsamių duomenų žyma	RM, MTF, OTF, APA	Sandoriai, kurių riboti duomenys jau buvo paskelbti pagal 11 straipsnio 1 dalies b punktą
11 straipsnio 1 dalies c punktas	FWAF	Keturių sav. suvestinės žyma	RM, MTF, OTF, APA	Sandorių suvestinių skelbimas pagal 11 straipsnio 1 dalies c punktą.
	FULJ	Išsamių duomenų žyma	RM, MTF, OTF, APA	Atskiri sandoriai, anksčiau paskelbti suvestinėse pagal 11 straipsnio 1 dalies c punktą.

PAPILDOMOS VALSTYBĖS OBLIGACIJŲ DUOMENŲ ATIDĖJIMO ŽYMOS				
11 straipsnio 3 dalies a punktas	OMIS	Neskelbiamos apimties žyma	RM, MTF, OTF, APA	Sandoriai, kurių riboti duomenys skelbiami pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 3 dalies a punktą.
	FULO	Išsamių duomenų žyma	RM, MTF, OTF, APA	Sandoriai, kurių riboti duomenys anksčiau skelbti pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 3 dalies a punktą
11 straipsnio 3 dalies b punktas	AGFW	Keturių sav. suvestinės žyma	RM, MTF, OTF, APA	Sandorių suvestinės skelbimas pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 3 dalies b punktą
	FULG	Išsamių duomenų žyma	RM, MTF, OTF, APA	Atskiri sandoriai, anksčiau skelbti suvestinėse pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 3 dalies b punktą.

KITOS ŽYMOS			
Žyma	Pavadinimas	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Aprašymas
BENC	Kontrolinio sandorio žyma	RM, MTF, OTF, APA	Sandoriai, įvykdyti atsižvelgiant į kainą, kuri apskaičiuojama keliais skirtingais laiko momentais pagal tam tikrą lyginamąjį standartą, pavyzdžiui, pagal apimtį arba pagal laiką įvertintą vidutinę kainą.
NPFT	Su kainodara nesusijusio sandorio žyma	RM, MTF, OTF, APA	Su kainodara nesusiję sandoriai, nustatyti Deleguotojo reglamento (ES) 2017/590 2 straipsnio 5 dalyje.

▼M4

KITOS ŽYMOS

Žyma	Pavadinimas	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Aprašymas
TPAC	Sudėtinio sandorio žyma	RM, MTF, OTF, APA	Sudėtiniai sandoriai, išskyrus pakeitimą fiziniu turtu, kaip apibrėžta Reglamento (ES) Nr. 600/2014 2 straipsnio 1 dalies 50 punkto b papunktyje.
XFPH	Pakeitimo fiziniu turtu sandorio žyma	RM, MTF, OTF, APA	Pakeitimas fiziniu turtu, kaip apibrėžta Reglamento (ES) Nr. 600/2014 2 straipsnio 1 dalies 48 punkte.
CANC	Anuliavimo žyma	RM, MTF, OTF, APA	Kai atšauktas anksčiau paskelbtas sandoris.
AMND	Pakeitimo žyma	RM, MTF, OTF, APA	Kai pakeistas anksčiau paskelbtas sandoris.
PORT	Prekybos portfeliais žyma	RM, MTF, OTF, APA	Penkių ar daugiau skirtingų finansinių priemonių sandoriai, kuriuos vienu metu ir kaip vieną lotą už konkrečią referencinę kainą vykdo tas pats klientas ir kurie nėra Reglamento (ES) Nr. 600/2014 2 straipsnio 1 dalies 50 punkte nurodytas sudėtinis sandoris.
MTCH	Tarpininko suderintų sandorių žyma	OTF	Tarpininko suderinti sandoriai, kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES 4 straipsnio 1 dalies 38 punkte.
NEGO	Suderėto sandorio žyma	RM, MTF, OTF	Sandoriai, dėl kurių suderėta privačiai, bet apie kuriuos pranešta pagal prekybos vietos taisykles.

▼M3

4 lentelė

Apimties matas

Priemonės rūšis	Apimtis
Visos obligacijos, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas, ir struktūrizuoti finansiniai produktai	Tariamoji sutarčių, kuriomis prekiaujama, suma pagal šio reglamento II priedo 2 lentelės 10 laukelį.
Biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijų rūšys	Tariamoji sutarčių, kuriomis prekiaujama, suma pagal šio reglamento II priedo 2 lentelės 10 laukelį.
Vertybiniais popieriais pakeistos išvestinės finansinės priemonės	Tariamoji sutarčių, kuriomis prekiaujama, suma pagal šio reglamento II priedo 2 lentelės 10 laukelį.
Palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės	Tariamoji sutarčių, kuriomis prekiaujama, suma pagal šio reglamento II priedo 2 lentelės 10 laukelį.
Užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės	Tariamoji sutarčių, kuriomis prekiaujama, suma pagal šio reglamento II priedo 2 lentelės 10 laukelį.
Su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės	Tariamoji sutarčių, kuriomis prekiaujama, suma pagal šio reglamento II priedo 2 lentelės 10 laukelį.
Biržos prekių išvestinės finansinės priemonės	Tariamoji sutarčių, kuriomis prekiaujama, suma pagal šio reglamento II priedo 2 lentelės 10 laukelį.
Kredito išvestinės finansinės priemonės	Tariamoji sutarčių, kuriomis prekiaujama, suma pagal šio reglamento II priedo 2 lentelės 10 laukelį.
Sandoris dėl kainų skirtumo	Tariamoji sutarčių, kuriomis prekiaujama, suma pagal šio reglamento II priedo 2 lentelės 10 laukelį.
C10 išvestinės finansinės priemonės	Tariamoji sutarčių, kuriomis prekiaujama, suma pagal šio reglamento II priedo 2 lentelės 10 laukelį.
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės	Kiekis matavimo vienetais pagal šio reglamento II priedo 2 lentelės 8 laukelį.
Apyvartiniai taršos leidimai	Kiekis matavimo vienetais pagal šio reglamento II priedo 2 lentelės 8 laukelį.

▼B

III PRIEDAS

Likvidumo vertinimas, didelės apimties ir priemonei būdingo dydžio ribos ne nuosavo kapitalo finansinėms priemonėms

▼M4

1. **Paaiškinimai dėl šio priedo paskirties**

1. 2.2 lentelėje nuoroda „neapmokėtų obligacijų emisijos dydis“ reiškia išleistų ir šiuo metu investuotojų turimų obligacijų bendrą vertę.

2. Nuoroda „turto klasė“ reiškia šias finansinių priemonių klases: obligacijas, struktūrizuotus finansinius produktus, vertybiniais popieriais pakeistas išvestines finansines priemones, palūkanų normų išvestines finansines priemones, su nuosavybės vertybiniais popieriais susietas išvestines finansines priemones, biržos prekių išvestines finansines priemones, užsienio valiutos keitimo išvestines finansines priemones, kredito išvestines finansines priemones, C10 išvestines finansines priemones, sandorius dėl kainų skirtumo, apyvartinius taršos leidimus ir apyvartinių taršos leidimų išvestines finansines priemones.

3. Nuoroda „turto poklasis“ reiškia turto klasę, suskaidytą į smulkesnius segmentus, remiantis sutarties ir (arba) pagrindinės priemonės rūšimi.

4. Nuoroda „poklasis“ reiškia turto poklasį, suskaidytą į smulkesnius segmentus, remiantis tolesnio kokybinio segmentavimo kriterijais, išdėstytais šio priedo 2.2–13.3 lentelėse.

5. Dienos tariamosios sumos vidurkis – bendra konkrečios finansinės priemonės tariamoji suma, apskaičiuota pagal II priedo 4 lentelėje nurodytą apimties matą ir pasiekta per 13 straipsnio 7 dalyje nurodytą laikotarpį, padalyta iš to laikotarpio arba atitinkamais atvejais tos metų dalies, kuriais finansine priemone buvo leista prekiauti ar prekiaujama prekybos vietoje ir jos prekyba nebuvo sustabdyta, prekybos dienų skaičiaus.

6. Sandorių skaičiaus dienos vidurkis – bendras įvykdytų konkrečios finansinės priemonės sandorių skaičius per 13 straipsnio 7 dalyje nurodytą laikotarpį, padalytas iš to laikotarpio arba atitinkamais atvejais tos metų dalies, kuriais finansine priemone buvo leista prekiauti ar prekiaujama prekybos vietoje ir jos prekyba nebuvo sustabdyta, prekybos dienų skaičiaus.

7. Ateities sandoris – sutartis dėl biržos prekių ar finansinių priemonių pirkimo ar pardavimo nustatytą dieną ateityje už kainą, dėl kurios pirkėjas ir pardavėjas susitaria pasirašydami sutartį. Kiekvienoje ateities sandorio sutartyje išdėstytos standartinės sąlygos dėl minimalaus perkamo ar parduodamo kiekio ir kokybės, mažiausios sumos, kuria gali kisti kaina, pateikimo tvarkos, termino dienos ir kitų su sutartimi susijusių elementų.

8. Pasirinkimo sandoris – sutartis, suteikianti savininkui teisę, bet jo neįpareigojanti nupirkti arba parduoti konkrečią finansinę priemonę ar biržos prekę už iš anksto nustatytą kainą ar vykdymo kainą konkrečią dieną ateityje ar vykdymo dieną arba anksčiau.

9. Apsikeitimo sandoris – sutartis, pagal kurią dvi šalys susitaria konkrečią dieną ateityje apsikeisti pinigų srautais, susijusiais su skirtingomis finansinėmis priemonėmis.

10. Portfelio apsikeitimo sandoris – sutartis, pagal kurią galutiniai vartotojai gali apsikeisti keletu apsikeitimo sandorių.

▼**M4**

11. Išankstinis sandoris (išankstinis susitarimas) – privatus dviejų šalių susitarimas dėl biržos prekės ar finansinės priemonės pirkimo ar pardavimo nustatytą dieną ateityje už kainą, dėl kurios pirkėjas ir pardavėjas susitaria sudarydami sandorį.

12. Pasirinkimo sandoris dėl apsikeitimo sandorio – sutartis, suteikianti savininkui teisę, bet jo neįpareigojanti sudaryti apsikeitimo sandorį tam tikrą dieną ateityje arba iki tos dienos arba iki įvykdymo dienos.

13. Ateities sandoris dėl apsikeitimo sandorio – ateities sandoris, kuriuo savininkas įpareigojamas konkrečią dieną ateityje arba anksčiau sudaryti apsikeitimo sandorį.

14. Išankstinis sandoris dėl apsikeitimo sandorio – išankstinis sandoris, kuriuo savininkas įpareigojamas konkrečią dieną ateityje arba anksčiau sudaryti apsikeitimo sandorį.

▼M4

2. **Obligacijos**

2.2 lentelė

Obligacijos (visų rūšių, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas). Klasės, kurių rinka nėra likvidi

Laikoma, kad kiekvienos konkrečios obligacijos rinka nėra likvidi pagal 6a straipsnį, jei jai būdingas konkretus obligacijos savybių derinys, kaip nurodyta kiekvienoje tolesnės lentelės eilutėje.

Valstybės ir kitos viešosios obligacijos						
Grupės kodas	**FPRR kodas**	**Obligacijų rūšis**	**Emitentas arba šalis emitentė**	**Likęs terminas**	**Atkarpos rūšis**	**Neapmokėtos emisijos dydis**
	RTS2#3	RTS2#9	Emitento, nurodyto Komisijos deleguotojo reglamento (ES) 2017/585 ([1]) (RTS23) laukelyje „Emitento arba prekybos vietos operatoriaus identifikatorius“, šalis	Laikas, likęs iki RTS23 laukelyje „Termino data“ nurodytos termino datos	Finansinių priemonių klasifikavimo (CFI) kodo, nurodyto RTS23 laukelyje „Priemonės klasifikacija“, trečia raidė	RTS23 laukelio „Bendra emisijos tariamoji suma“ vertė, konvertuota į EUR
G1	OBLIGACIJA	EUSB EUSB – obligacija, kuri nėra nei konvertuojamoji, nei padengtoji obligacija ir kurią išleido vienas iš šių valstybės skolos vertybinių popierių emitentų: a) Sąjunga; b) valstybė narė, įskaitant valstybės narės Vyriausybės departamentus, įstaigas ar specialiosios paskirties įmones; c) federacinės valstybės narės atveju – federacijos narė; d) kelių valstybių narių specialiosios paskirties subjektas; e) tarptautinė finansų įstaiga, įsteigta dviejų ar daugiau valstybių narių, siekiančių sutelkti finansavimą ir suteikti finansinę pagalbą savo nariams, kurie patiria ar kuriems gresia patirti rimtų finansinių problemų; f) Europos investicijų bankas; g) trečiosios valstybės valstybės subjektas.	Emitento šalis yra valstybė narė, Jungtinės Amerikos Valstijos arba Jungtinė Karalystė, ARBA emitentas yra Sąjunga.	Iki 10 metų (imtinai)	F (fiksuota atkarpa)	Mažiau kaip 5 000 000 000 EUR
G2	OBLIGACIJA	EUSB arba OEPB OEPB – obligacija, kuri nėra nei konvertuojamoji, nei padengtoji obligacija ir kurią išleido viešasis subjektas, kuris nėra valstybės skolos vertybinių popierių emitentas.	G1 grupei nepriskiriama priemonė			Mažiau kaip 1 000 000 000 EUR

([1]) 2016 m. liepos 14 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/585, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 papildomas techniniais reguliavimo standartais, susijusiais su finansinių priemonių bazinių duomenų standartais bei formatu ir su techninėmis priemonėmis dėl tvarkos, kurią turi nustatyti Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija ir kompetentingos institucijos (OL L 87, 2017 3 31, p. 368, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/585/oj).

▼M4

Įmonių, konvertuojamosios ir kitos obligacijos					
Grupės kodas	**FPRR kodas**	**Obligacijų rūšis**	**Valiuta**	**Kredito reitingas**	**Neapmokėtos emisijos dydis**
	RTS2#3	RTS2#9	RTS23 laukelyje „1 tariamosios sumos valiuta“ nurodytos priemonės valiuta		RTS23 laukelio „Bendra emisijos tariamoji suma“ vertė, konvertuota į EUR
G3	OBLIGACIJA	CRPB, CVTB arba OTHR CRPB – obligacija, kuri nėra nei konvertuojamoji, nei padengtoji obligacija ir kurią išleido pagal Tarybos reglamentą (EB) Nr. 2157/2001 ([1]) įsteigtos Europos akcinės bendrovės arba Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2013/34/ES ([2]) I arba II priede nurodytų rūšių bendrovės ar jų atitikmenys trečiosiose valstybėse. CVTB – finansinė priemonė, kurią sudaro obligacija ar skolos vertybinis popierius, apimantis išvestinę finansinę priemonę, kaip antai pasirinkimo sandorį dėl pagrindinio nuosavo kapitalo įsigijimo.	EUR, GBP, USD	Investicinis reitingas	Mažiau kaip 500 000 000 EUR
G4	OBLIGACIJA	CRPB, CVTB arba OTHR	G3 grupei nepriskiriama priemonė		Mažiau kaip 500 000 000 EUR

([1]) 2001 m. spalio 8 d. Tarybos reglamentas (EB) Nr. 2157/2001 dėl Europos bendrovės (SE) statuto (OL L 294, 2001 11 10, p. 1 ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2001/2157/oj).
([2]) 2013 m. birželio 26 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2013/34/ES dėl tam tikrų rūšių įmonių metinių finansinių ataskaitų, konsoliduotųjų finansinių ataskaitų ir susijusių pranešimų, kuria iš dalies keičiama Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2006/43/EB ir panaikinamos Tarybos direktyvos 78/660/EEB ir 83/349/EEB, (OL L 182, 2013 6 29, p. 19, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2013/34/oj).

Padengtosios obligacijos			
Grupės kodas	**FPRR kodas**	**Obligacijų rūšis**	**Neapmokėtos emisijos dydis**
	RTS2#3	RTS2#9	RTS23 laukelio „Bendra emisijos tariamoji suma“ vertė, konvertuota į EUR
G5	OBLIGACIJA	CVDB CVDB – obligacija, nurodyta Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2009/65/EB ([1]) 52 straipsnio 4 dalyje.	Mažiau kaip 500 000 000 EUR

([1]) 2009 m. liepos 13 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2009/65/EB dėl įstatymų ir kitų teisės aktų, susijusių su kolektyvinio investavimo į perleidžiamus vertybinius popierius subjektais (KIPVPS), derinimo (OL L 302, 2009 11 17, p. 32, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2009/65/oj).

▼M4

2.3 lentelė

Obligacijos (visų rūšių, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas). Didelės apimties ribos iki sandorio sudarymo

Turto klasė – obligacijos (visų rūšių, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas)	
Obligacijų rūšis	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**
Valstybės obligacijos ir kitos valstybės obligacijos	5 000 000 EUR
Įmonių, konvertuojamosios ir kitos obligacijos	1 000 000 EUR
Padengtosios obligacijos	5 000 000 EUR

2.4 lentelė

Obligacijos (biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijų rūšys). Klasės, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – obligacijos (biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijų rūšys)	
Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6a straipsnį, taikomi šie metodai:	
Biržinės prekės – RTS2#3 = ETCS Skolos priemonė, išleista emitento tiesioginės investicijos į biržos prekes ar biržos prekių išvestinių priemonių sutartis atžvilgiu. Biržinės prekės kaina yra tiesiogiai ar netiesiogiai susieta su pagrindinės finansinės priemonės rezultatais. Biržinė prekė pasyviai atspindi biržos prekės ar biržos prekių indeksų, su kuriais ji susieta, rezultatus.	Laikoma, kad visų biržinių prekių rinka nėra likvidi.
Biržiniai vekseliai – RTS2#3 = ETNS Skolos priemonė, išleista emitento tiesioginės investicijos į pagrindinę finansinę priemonę ar pagrindinės finansinės priemonės išvestinių priemonių sutartis atžvilgiu. Biržinio vekselio kaina yra tiesiogiai ar netiesiogiai susieta su pagrindinės finansinės priemonės rezultatais. Biržinis vekselis pasyviai atspindi pagrindinės finansinės priemonės, su kuria jis susietas, rezultatus.	Laikoma, kad visų biržinių vekselių rinka nėra likvidi.

2.5 lentelė

Obligacijos (biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijų rūšys) – didelės apimties riba iki sandorio sudarymo

Turto klasė – obligacijos (biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijų rūšys)	
Obligacijų rūšis	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**
Biržinės prekės	1 000 000 EUR
Biržiniai vekseliai	1 000 000 EUR

▼M4

2.6 lentelė

Obligacijos (visų rūšių, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas). Atidėjimo tvarka

Turto klasė – obligacijos (visų rūšių, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas)			
Obligacijų rūšis	**Kategorija**	**Likvidumas**	**Dydis (lygus arba didesnis)**
Pagal 2.2 lentelę G1 grupei priskirtos valstybės obligacijos	1	Laikoma, kad rinka yra likvidi	15 000 000 EUR
	2	Laikoma, kad rinka nėra likvidi	5 000 000 EUR
	3	Laikoma, kad rinka yra likvidi	50 000 000 EUR
	4	Laikoma, kad rinka nėra likvidi	15 000 000 EUR
	5	Laikoma, kad rinka yra likvidi	100 000 000 EUR
	5	Laikoma, kad rinka nėra likvidi	50 000 000 EUR
Pagal 2.2 lentelę G2 grupei priskirtos valstybės obligacijos ir kitos valstybės obligacijos	1	Laikoma, kad rinka yra likvidi	10 000 000 EUR
	2	Laikoma, kad rinka nėra likvidi	1 000 000 EUR
	3	Laikoma, kad rinka yra likvidi	20 000 000 EUR
	4	Laikoma, kad rinka nėra likvidi	2 000 000 EUR
	5	Laikoma, kad rinka yra likvidi	50 000 000 EUR
	5	Laikoma, kad rinka nėra likvidi	5 000 000 EUR
Pagal 2.2 lentelę G3 grupei priskirtos įmonių, konvertuojamosios ir kitos obligacijos	1	Laikoma, kad rinka yra likvidi	1 500 000 EUR
	2	Laikoma, kad rinka nėra likvidi	500 000 EUR
	3	Laikoma, kad rinka yra likvidi	7 500 000 EUR
	4	Laikoma, kad rinka nėra likvidi	2 000 000 EUR
	5	Laikoma, kad rinka yra likvidi	15 000 000 EUR
	5	Laikoma, kad rinka nėra likvidi	5 000 000 EUR

▼M4

Turto klasė – obligacijos (visų rūšių, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas)			
Obligacijų rūšis	**Kategorija**	**Likvidumas**	**Dydis (lygus arba didesnis)**
Pagal 2.2 lentelę G4 grupei priskirtos įmonių, konvertuojamosios ir kitos obligacijos	1	Laikoma, kad rinka yra likvidi	1 000 000 EUR
	2	Laikoma, kad rinka nėra likvidi	500 000 EUR
	3	Laikoma, kad rinka yra likvidi	5 000 000 EUR
	4	Laikoma, kad rinka nėra likvidi	2 000 000 EUR
	5	Laikoma, kad rinka yra likvidi	10 000 000 EUR
	5	Laikoma, kad rinka nėra likvidi	5 000 000 EUR
Pagal 2.2 lentelę G5 grupei priskirtos padengtosios obligacijos	1	Laikoma, kad rinka yra likvidi	5 000 000 EUR
	2	Laikoma, kad rinka nėra likvidi	1 000 000 EUR
	3	Laikoma, kad rinka yra likvidi	20 000 000 EUR
	4	Laikoma, kad rinka nėra likvidi	5 000 000 EUR
	5	Laikoma, kad rinka yra likvidi	50 000 000 EUR
	5	Laikoma, kad rinka nėra likvidi	10 000 000 EUR

3. **Struktūrizuoti finansiniai produktai (SFP)**

3.1 lentelė

SFP. Klasės, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – struktūrizuoti finansiniai produktai (SFP)
SFP turto klasės įvertinimas, siekiant nustatyti finansines priemones, kurių rinka nėra likvidi pagal 6a straipsnį (RTS2#3 laukelio vertė = SFPS)
Laikoma, kad visų struktūrizuotų finansinių produktų rinka nėra likvidi.

3.2 lentelė

SFP – didelės apimties riba iki sandorio sudarymo

Turto klasė – struktūrizuoti finansiniai produktai (SFP)
Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo
250 000 EUR

▼B

4. **Vertybiniais popieriais pakeistos išvestinės finansinės priemonės**

▼M3

4.1 lentelė

Vertybiniais popieriais pakeistos išvestinės finansinės priemonės – klasės, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – vertybiniais popieriais pakeistos išvestinės finansinės priemonės
Perleidžiamasis vertybinis popierius, kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES 4 straipsnio 1 dalies 44 punkto c papunktyje, kuris skiriasi nuo struktūrizuotų finansinių produktų ir apima bent:
a.1) paprastuosius padengtus varantus, t. y. finansų įstaigos išleistus vertybinius popierius, kurie turėtojui suteikia teisę, bet jo neįpareigoja:
a) galiojimo pabaigos dieną arba anksčiau nupirkti tam tikrą pagrindinio turto kiekį iš anksto nustatyta vykdymo kaina arba, jei susitarta dėl atsiskaitymo grynaisiais, iš pardavėjo gauti sumą, lygią teigiamam dabartinės rinkos kainos ir vykdymo kainos skirtumui; arba
b) galiojimo pabaigos dieną arba anksčiau parduoti tam tikrą pagrindinio turto kiekį iš anksto nustatyta vykdymo kaina arba, jei susitarta dėl atsiskaitymo grynaisiais, iš pirkėjo gauti sumą, lygią teigiamam vykdymo kainos ir dabartinės rinkos kainos skirtumui;
a.2) varantus, t. y. vertybinius popierius, kuriuos išleido tas pats pagrindinio turto emitentas, kurie turėtojui suteikia teisę, bet jo neįpareigoja:
a) galiojimo pabaigos dieną arba anksčiau nupirkti tam tikrą pagrindinio turto kiekį iš anksto nustatyta vykdymo kaina arba, jei susitarta dėl atsiskaitymo grynaisiais, iš pardavėjo gauti sumą, lygią teigiamam dabartinės rinkos kainos ir vykdymo kainos skirtumui; arba
b) galiojimo pabaigos dieną arba anksčiau parduoti tam tikrą pagrindinio turto kiekį iš anksto nustatyta vykdymo kaina arba, jei susitarta dėl atsiskaitymo grynaisiais, iš pirkėjo gauti sumą, lygią teigiamam vykdymo kainos ir dabartinės rinkos kainos skirtumui;
b) sverto sertifikatus, t. y. sertifikatus, kurie atitinka pagrindinio turto rezultatus, taikant sverto poveikį;
c) egzotinius padengtus varantus, t. y. padengtus varantus, kurių pagrindinė sudedamoji dalis yra pa sirinkimo sandorių derinys;
d) perleidžiamąsias teises, kurių pagrindinė priemonė yra ne nuosavybės finansinė priemonė;
e) investicijų sertifikatus, t. y. sertifikatus, kurie atitinka pagrindinio turto rezultatus be sverto poveikio.
RTS2#3 = SDRV
Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, taikomi šie metodai
Laikoma, kad visų vertybiniais popieriais pakeistų išvestinių finansinių priemonių rinka yra likvidi.

▼M4

4.2 lentelė

Vertybiniais popieriais pakeistos išvestinės finansinės priemonės. Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo

Turto klasė – vertybiniais popieriais pakeistos išvestinės finansinės priemonės		
Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo		
Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

▼B

5. **Palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės**

▼M3

5.1 lentelė

Palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės – klasės, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės				
Visos Direktyvos 2014/65/ES I priedo C skirsnio 4 punkte apibrėžtos sutartys, kurių galutinė pagrindinė finansinė priemonė yra palūkanų norma, obligacija, paskola, bet koks krepšelis, portfelis ar indeksas, apimantis palūkanų normą, obligaciją, paskolą ar bet kokį kitą produktą, atspindintį palūkanų normos, obligacijos ar paskolos rezultatus.				
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
Obligacijų ateities / išankstiniai sandoriai **/ Ateities sandoris dėl obligacijų ateities sandorio**	Obligacijų ateities / išankstinių sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS2#17) – pagrindinės priemonės emitentas **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#18) – pagrindinės pateikiamos obligacijos terminas, apibrėžiamas taip:	5 000 000 EUR	10	Jei poklasis laikomas turinčiu likvidžią rinką konkrečiu laiku iki terminų intervalo, o poklasis, susijęs su vėlesniu laiku iki terminų intervalo, laikomas neturinčiu likvidžios

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
/ Išankstinis sandoris dėl obligacijų ateities sandorioAteities sandoris dėl obligacijų **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = BOND** **arba** **Išankstinis sandoris dėl obligacijų** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FORW** **RTS2#16 = BOND** **arba** **Ateities sandoris dėl obligacijų ateities sandorio** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR**	**trumpas**: pagrindinė pateikiama obligacija, kurios terminas – iki 4 metų, laikoma trumpo termino obligacija; **vidutinės trukmės**: pagrindinė pateikiama obligacija, kurios terminas – nuo 4 iki 8 metų, laikoma vidutinės trukmės termino obligacija; **ilgas**: pagrindinė pateikiama obligacija, kurios terminas – nuo 8 iki 15 metų, laikoma ilgo termino obligacija; **labai ilgas**: pagrindinė pateikiama obligacija, kurios terminas ilgesnis nei 15 metų, laikoma labai ilgo termino obligacija. **3 segmentavimo kriterijus – laikotarpis iki ateities sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:** 1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. 2 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. 3 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai 4 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai 5 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai			rinkos, pirmoji tolimesnio mėnesio sutartis (angl. *back month contract*) laikoma turinčia likvidžią rinką 2 sav. iki artimesnio mėnesio pabaigos.

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
RTS2#5 = FUTR **RTS2#16 = BNFD** **arba** **Išankstinis sandoris dėl obligacijų ateities sandorio** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FORW** **RTS2#16 = BNFD**				
Obligacijų pasirinkimo sandoris **/ Pasirinkimo sandoris dėl obligacijų pasirinkimo sandorio** **/ Pasirinkimo sandoris dėl obligacijų ateities sandorio** **Obligacijų pasirinkimo sandoris** **Pasirinkimo sandoris dėl obligacijų pasirinkimo sandorio** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR**	Obligacijų pasirinkimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus (RTS2#22) – galutinė pagrindinė obligacija** **2 segmentavimo kriterijus (RTS2#8) – laikotarpis iki pasirinkimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:** 1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. 2 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. 3 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai 4 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai 5 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	5 000 000 EUR	10	

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
RTS2#5 = OPTN **RTS2#16 = BOND** **arba** **Pasirinkimo sandoris dėl obligacijų pasirinkimo sandorio** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = BOND** **arba** **Pasirinkimo sandoris dėl obligacijų ateities sandorio** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = BNFD**				

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
Ateities ir išankstiniai palūkanų normų sandoriai / Ateities sandoris dėl palūkanų normų ateities sandorio / Išankstinis palūkanų normų sandoris dėl palūkanų normų ateities sandorio **Ateities sandoris dėl palūkanų normų** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = INTR** **arba** **Išankstinis palūkanų normų sandoris** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FRAS** **RTS2#16 = INTR** **arba** **Ateities sandoris dėl palūkanų normų ateities sandorio**	Palūkanų normų ateities sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus (RTS2#24) – pagrindinė palūkanų norma** **2 segmentavimo kriterijus (RTS2#25) – pagrindinės palūkanų normos terminas** **3 segmentavimo kriterijus (RTS2#8) – laikotarpis iki ateities sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:** 1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. 2 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. 3 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai 4 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai 5 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	500 000 000 EUR	10	Jei poklasis laikomas turinčiu likvidžią rinką konkrečiu laiku iki terminų intervalo, o poklasis, susijęs su vėlesniu laiku iki terminų intervalo, laikomas neturinčiu likvidžios rinkos, pirmoji tolimesnio mėnesio sutartis (angl. *back month contract*) laikoma turinčia likvidžią rinką 2 sav. iki artimesnio mėnesio pabaigos.

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
RTS2#3 = DERV **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = IFUT** **arba** **Išankstinis palūkanų normų sandoris dėl palūkanų normų ateities sandorio** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FRAS** **RTS2#16 = IFUT**				
Palūkanų normų pasirinkimo sandoriai **/ Pasirinkimo sandoris dėl palūkanų normų ateities sandorio / Išankstinis palūkanų normų sandoris** **/ Pasirinkimo sandoris dėl palūkanų normos pasirinkimo sandorio**	Palūkanų normų pasirinkimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus (RTS2#24) – pagrindinė palūkanų norma** **2 segmentavimo kriterijus (RTS2#25) – pagrindinės palūkanų normos terminas** **3 segmentavimo kriterijus (RTS2#8) – laikotarpis iki pasirinkimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:** 1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn.	500 000 000 EUR	10	

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
/ Pasirinkimo sandoris dėl pasirinkimo sandorio dėl palūkanų normų ateities sandorio / Išankstinis palūkanų normų sandoris **Pasirinkimo sandoris dėl palūkanų normų ateities sandorio / Išankstinis palūkanų normų sandoris / Pasirinkimo sandoris dėl palūkanų normos pasirinkimo sandorio** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = IFUT** **arba** **Palūkanų normų pasirinkimo sandoris / Pasirinkimo sandoris dėl pasirinkimo sandorio dėl palūkanų normų ateities sandorio / Išankstinis palūkanų normų sandoris** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = INTR**	2 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. 3 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai 4 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai 5 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai			

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
Pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo sandorių **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = SWPT**	Pasirinkimo sandorių dėl apsikeitimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS2#16) – apsikeitimo pagrindine priemone rūšis, apibrėžiama taip: apsikeitimo viena valiuta fiksuotomis palūkanomis sandoris, ateities / išankstinis sandoris dėl apsikeitimo viena valiuta fiksuotomis palūkanomis sandorio [**RTS2#16 = XXSC**] apsikeitimo vieta valiuta sandoris, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos, ateities / išankstinis sandoris dėl apsikeitimo viena valiuta sandorio, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos [**RTS2#16 = XFSC**] apsikeitimo viena valiuta kintamomis palūkanomis sandoris, ateities / išankstinis sandoris dėl apsikeitimo viena valiuta kintamomis palūkanomis sandorio [**RTS2#16 = FFSC**] apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandoris, ateities / išankstinis sandoris dėl apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandorio [**RTS2#16 = IFSC**] apsikeitimo palūkanų normomis pagal vienos nakties indeksą viena valiuta sandoris, ateities / išankstinis sandoris dėl apsikeitimo palūkanų normomis pagal vienos nakties indeksą viena valiuta sandorio [**RTS2#16 = OSSC**] apsikeitimo keliomis valiutomis fiksuotomis palūkanomis sandoris, ateities / išankstinis sandoris dėl apsikeitimo keliomis valiutomis fiksuotomis palūkanomis sandorio [**RTS2#16 = XXMC**]	500 000 000 EUR	10	

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
	apsikeitimo keliomis valiutomis sandoris, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos, ateities / išankstinis sandoris dėl apsikeitimo keliomis valiutomis sandorio, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos [**RTS2#16 = XFMC]** apsikeitimo keliomis valiutomis kintamomis palūkanomis sandoris, ateities / išankstinis sandoris dėl apsikeitimo keliomis valiutomis kintamomis palūkanomis sandorio [**RTS2#16 = FFMC]** apsikeitimo infliacijos rizika keliomis valiutomis sandoris, ateities / išankstinis sandoris dėl apsikeitimo infliacijos rizika keliomis valiutomis sandorio [**RTS2#16 = IFMC]** apsikeitimo palūkanų normomis pagal vienos nakties indeksą keliomis valiutomis sandoris, ateities/išankstinis sandoris dėl apsikeitimo palūkanų normomis pagal vienos nakties indeksą keliomis valiutomis sandorio [**RTS2#16 = OSMC]** **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#20) – tariamosios sumos valiuta, apibrėžiama kaip valiuta, kuria denominuota pasirinkimo sandorio tariamoji suma **3 segmentavimo kriterijus** (RTS2#22 arba RTS2#23) – infliacijos indeksas, jei pagrindinės priemonės apsikeitimo sandorio rūšis yra apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandoris arba apsikeitimo infliacijos rizika keliomis valiutomis sandoris **4 segmentavimo kriterijus** (RTS2#21) – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: 1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn. 2 terminų intervalas: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn.			

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
	3 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. 4 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai 5 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai 6 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai **5 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki pasirinkimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas**: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. **2 terminų intervalas**: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **3 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai **4 terminų intervalas**: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 5 metai **5 terminų intervalas**: 5 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 10 metai **6 terminų intervalas: daugiau nei 10 metų**			

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo sandoriai, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos, ir ateities / išankstiniai / pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo sandorių, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos Apsikeitimo sandoris arba ateities / išankstinis / pasirinkimo sandoris dėl apsikeitimo sandorio, kai dvi šalys apsikeičia pinigų srautais, denominuotais skirtingomis valiutomis, ir vienos sandorio dalies pinigų srautams taikoma fiksuota palūkanų norma, o kitos sandorio dalies pinigų srautams taikoma kintama palūkanų norma **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP arba FONS arba FWOS arba OPTS RTS2#16 = XFMC	Apsikeitimo keliomis valiutomis sandorių, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos, poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#13 ir RTS23#42) – tariamosios valiutos pora, apibrėžiama kaip dviejų valiutų, kuriomis denominuotos abi apsikeitimo sandorio dalys, derinys **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: 1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn. 2 terminų intervalas: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. 3 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. 4 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai 5 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai 6 terminų intervalas: 2 metai < terminas ≤ 3 metai … m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo kintamomis palūkanomis sandoriai ir ateities / išankstiniai / pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo kintamomis palūkanomis sandorių Apsikeitimo sandoris arba ateities / išankstinis / pasirinkimo sandoris dėl apsikeitimo sandorio, kai dvi šalys apsikeičia pinigų srautais, denominuotais skirtingomis valiutomis, ir abiejų sandorio dalių pinigų srautams taikomos kintamos palūkanų normos RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP arba FONS arba FWOS arba OPTS RTS2#16 = FFMC	Apsikeitimo keliomis valiutomis kintamomis palūkanomis sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#13 ir RTS23#42) – tariamosios valiutos pora, apibrėžiama kaip dviejų valiutų, kuriomis denominuotos abi apsikeitimo sandorio dalys, derinys **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: 1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn. 2 terminų intervalas: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. 3 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. 4 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai 5 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai 6 terminų intervalas: 2 metai < terminas ≤ 3 metai … m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo fiksuotomis palūkanomis sandoriai ir ateities / išankstiniai / pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo fiksuotomis palūkanomis sandorių Apsikeitimo sandoris arba ateities / išankstinis / pasirinkimo sandoris dėl apsikeitimo sandorio, kai dvi šalys apsikeičia pinigų srautais, denominuotais skirtingomis valiutomis, ir abiejų sandorio dalių pinigų srautams taikomos fiksuotos palūkanų normos RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP arba FONS arba FWOS arba OPTS RTS2#16 = XXMC	Apsikeitimo keliomis valiutomis fiksuotomis palūkanomis sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#13 ir RTS23#42) – tariamosios valiutos pora, apibrėžiama kaip dviejų valiutų, kuriomis denominuotos abi apsikeitimo sandorio dalys, derinys **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: 1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn. 2 terminų intervalas: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. 3 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. 4 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai 5 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai 6 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
Apsikeitimo palūkanų normomis keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo pagal vienos nakties indeksą sandoriai ir ateities / išankstiniai / pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo palūkanų normomis keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo pagal vienos nakties indeksą sandorių Apsikeitimo sandoris arba ateities / išankstinis / pasirinkimo sandoris dėl apsikeitimo sandorio, kai dvi šalys apsikeičia pinigų srautais, denominuotais skirtingomis valiutomis, ir bent vienos sandorio dalies pinigų srautams taikoma apsikeitimo palūkanų normomis pagal vienos nakties indeksą norma RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP arba FONS arba FWOS arba OPTS RTS2#16 = OSMC	Apsikeitimo palūkanų normomis keliomis valiutomis pagal vienos nakties indeksą sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#13 ir RTS23#42) – tariamosios valiutos pora, apibrėžiama kaip dviejų valiutų, kuriomis denominuotos abi apsikeitimo sandorio dalys, derinys **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: 1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn. 2 terminų intervalas: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. 3 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. 4 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai 5 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai 6 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo infliacijos rizika sandoriai ir ateities / išankstiniai / pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo infliacijos rizika sandorių Apsikeitimo sandoris arba ateities / išankstinis / pasirinkimo sandoris dėl apsikeitimo sandorio, kai dvi šalys apsikeičia pinigų srautais, denominuotais skirtingomis valiutomis, ir bent vienos iš sandorio dalių pinigų srautas priklauso nuo infliacijos lygio **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP arba FONS arba FWOS arba OPTS RTS2#16 = IFMC	Apsikeitimo infliacijos rizika keliomis valiutomis sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#13 ir RTS23#42) – tariamosios valiutos pora, apibrėžiama kaip dviejų valiutų, kuriomis denominuotos abi apsikeitimo sandorio dalys, derinys **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: 1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn. 2 terminų intervalas: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. 3 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. 4 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai 5 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai 6 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
Apsikeitimo viena valiuta sandoriai, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos, ir ateities / išankstiniai / pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo viena valiuta sandorių, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos Apsikeitimo sandoris arba ateities / išankstinis / pasirinkimo sandoris dėl apsikeitimo sandorio, kai dvi šalys apsikeičia pinigų srautais, denominuotais ta pačia valiuta, ir vienos sandorio dalies pinigų srautams taikoma fiksuota palūkanų norma, o kitos sandorio dalies pinigų srautams taikoma kintama palūkanų norma **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP arba FONS arba FWOS arba OPTS RTS2#16 = XFSC	Apsikeitimo viena valiuta sandorių, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos, poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#13) – tariamosios sumos valiuta, kuria denominuotos abi apsikeitimo sandorio dalys **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: 1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn. 2 terminų intervalas: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. 3 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. 4 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai 5 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai 6 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
Apsikeitimo viena valiuta kintamomis palūkanomis sandoriai ir ateities / išankstiniai / pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo viena valiuta kintamomis palūkanomis sandorių Apsikeitimo sandoris arba ateities / išankstinis / pasirinkimo sandoris dėl apsikeitimo sandorio, kai dvi šalys apsikeičia pinigų srautais, denominuotais ta pačia valiuta, ir abiejų sandorio dalių pinigų srautams taikomos kintamos palūkanų normos RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP arba FONS arba FWOS arba OPTS RTS2#16 = FFSC	Apsikeitimo viena valiuta kintamomis palūkanomis sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#13) – tariamosios sumos valiuta, kuria denominuotos abi apsikeitimo sandorio dalys **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: 1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn. 2 terminų intervalas: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. 3 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. 4 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai 5 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai 6 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
Apsikeitimo viena valiuta fiksuotomis palūkanomis sandoriai ir ateities / išankstiniai / pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo viena valiuta fiksuotomis palūkanomis sandorių Apsikeitimo sandoris arba ateities / išankstinis / pasirinkimo sandoris dėl apsikeitimo sandorio, kai dvi šalys apsikeičia pinigų srautais, denominuotais ta pačia valiuta, ir abiejų sandorio dalių pinigų srautams taikomos fiksuotos palūkanų normos RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP arba FONS arba FWOS arba OPTS RTS2#16 = XXSC	Apsikeitimo viena valiuta fiksuotomis palūkanomis sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#13) – tariamosios sumos valiuta, kuria denominuotos abi apsikeitimo sandorio dalys **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: 1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn. 2 terminų intervalas: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. 3 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. 4 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai 5 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai 6 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
Apsikeitimo palūkanų normomis pagal vienos nakties indeksą viena valiuta sandoriai ir ateities / išankstiniai / pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo palūkanų normomis pagal vienos nakties indeksą viena valiuta sandorių Apsikeitimo sandoris arba ateities / išankstinis / pasirinkimo sandoris dėl apsikeitimo sandorio, kai dvi šalys apsikeičia pinigų srautais, denominuotais ta pačia valiuta, ir bent vienos sandorio dalies pinigų srautams taikoma apsikeitimo palūkanų normomis pagal vienos nakties indeksą norma **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP arba FONS arba FWOS arba OPTS RTS2#16 = OSSC	Apsikeitimo palūkanų normomis pagal vienos nakties indeksą (VNI) viena valiuta sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#13) – tariamosios sumos valiuta, kuria denominuotos abi apsikeitimo sandorio dalys **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: 1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn. 2 terminų intervalas: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. 3 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. 4 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai 5 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai 6 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
Apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandoriai ir ateities / išankstiniai / pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandorių Apsikeitimo sandoris arba ateities / išankstinis / pasirinkimo sandoris dėl apsikeitimo sandorio, kai dvi šalys apsikeičia pinigų srautais, denominuotais ta pačia valiuta, ir bent vienos iš sandorio dalių pinigų srautams taikomas infliacijos lygis **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP arba FONS arba FWOS arba OPTS RTS2#16 = IFSC	Apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#13) – tariamosios sumos valiuta, kuria denominuotos abi apsikeitimo sandorio dalys **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: 1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn. 2 terminų intervalas: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. 3 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. 4 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai 5 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai 6 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės	
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, taikomi šie metodai**
Kitos palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės Palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės, nepriklausančios nė vienam iš pirmiau išvardytų turto poklasių **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = OTHR	Laikoma, kad bet kokių kitų palūkanų normų išvestinių finansinių priemonių rinka nėra likvidi.

▼M4

5.2 lentelė

Palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės. Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės									
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo visiems poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia**								
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Obligacijų ateities / išankstiniai sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	5 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
Obligacijų pasirinkimo sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	5 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
Ateities ir išankstiniai palūkanų normų sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	10 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR

▼M4

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės									
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo visiems poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia**								
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Palūkanų normų pasirinkimo sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	10 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
Pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo sandorių	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo sandoriai, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos, ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo sandorių, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės									
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo visiems poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia**								
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo kintamomis palūkanomis sandoriai ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo kintamomis palūkanomis sandorių	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo fiksuotomis palūkanomis sandoriai ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo fiksuotomis palūkanomis sandorių	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės									
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo visiems poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia**								
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Apsikeitimo palūkanų normomis keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo pagal vienos nakties indeksą sandoriai ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo palūkanų normomis keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo pagal vienos nakties indeksą sandorių	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo infliacijos rizika sandoriai ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo infliacijos rizika sandorių	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Apsikeitimo viena valiuta sandoriai, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos, ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo viena valiuta sandorių, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės									
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo visiems poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia**								
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Apsikeitimo viena valiuta kintamomis palūkanomis sandoriai ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo viena valiuta kintamomis palūkanomis sandorių	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Apsikeitimo viena valiuta fiksuotomis palūkanomis sandoriai ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo viena valiuta fiksuotomis palūkanomis sandorių	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Apsikeitimo palūkanų normomis pagal vienos nakties indeksą viena valiuta sandoriai ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo palūkanų normomis pagal vienos nakties indeksą viena valiuta sandorių	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės									
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo visiems poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia**								
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandoriai ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandorių	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

5.3 lentelė

Palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės. Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos poklasiams, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo kiekvienam poklasiui, kurio rinka nėra likvidi**		
	Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Obligacijų ateities / išankstiniai sandoriai	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Obligacijų pasirinkimo sandoriai	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Ateities ir išankstiniai palūkanų normų sandoriai	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR

▼M4

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo kiekvienam poklasiui, kurio rinka nėra likvidi**		
	Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Palūkanų normų pasirinkimo sandoriai	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo sandorių	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo sandoriai, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos, ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo sandorių, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo kintamomis palūkanomis sandoriai ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo kintamomis palūkanomis sandorių	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo fiksuotomis palūkanomis sandoriai ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo fiksuotomis palūkanomis sandorių	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Apsikeitimo palūkanų normomis keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo pagal vienos nakties indeksą sandoriai ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo palūkanų normomis keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo pagal vienos nakties indeksą sandorių	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo infliacijos rizika sandoriai ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo infliacijos rizika sandorių	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Apsikeitimo viena valiuta sandoriai, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos, ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo viena valiuta sandorių, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR

▼M4

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo kiekvienam poklasiui, kurio rinka nėra likvidi**		
	Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Apsikeitimo viena valiuta kintamomis palūkanomis sandoriai ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo viena valiuta kintamomis palūkanomis sandorių	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Apsikeitimo viena valiuta fiksuotomis palūkanomis sandoriai ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo viena valiuta fiksuotomis palūkanomis sandorių	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Apsikeitimo palūkanų normomis pagal vienos nakties indeksą viena valiuta sandoriai ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo palūkanų normomis pagal vienos nakties indeksą viena valiuta sandorių	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandoriai ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandorių	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Kitos palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR

▼B

6. **Su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės**

▼M3

6.1 lentelė

Su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės – klasės, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės
Bet kokia sutartis, apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES I priedo C skirsnio 4 punkte ir susijusi su:
a) viena ar keliomis akcijomis, depozitaro pakvitavimais, biržiniais fondais, sertifikatais, kitomis panašiomis finansinėmis priemonėmis, pinigų srautais ar kitais produktais, susijusiais su vienos ar keleto akcijų, depozitoriumo pakvitavimų, biržinių fondų, sertifikatų ar kitų panašių finansinių priemonių rezultatais;
b) akcijų, depozitoriumo pakvitavimų, biržinių fondų, sertifikatų, kitų panašių finansinių priemonių, pinigų srautų ar kitų produktų, susijusių su vienos ar keleto akcijų, depozitoriumo pakvitavimų, biržinių fondų, sertifikatų ar kitų panašių finansinių priemonių rezultatais, indeksu.

▼M3

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės	
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, taikomi šie metodai**
Akcijų indekso pasirinkimo sandoriai Pasirinkimo sandoris, kurio pagrindinė priemonė yra iš akcijų sudarytas indeksas RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = STIX RTS23#26 arba, jei vertė nulis – RTS23#28	Laikoma, kad visų indekso pasirinkimo sandorių rinka yra likvidi.
Akcijų indekso ateities / išankstiniai sandoriai Ateities / išankstinis sandoris, kurio pagrindinė priemonė yra iš akcijų sudarytas indeksas RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR arba FORW RTS2#27 = STIX RTS23#26 arba, jei vertė nulis – RTS23#28	Laikoma, kad visų indekso ateities / išankstinių sandorių rinka yra likvidi.
Akcijų pasirinkimo sandoriai Pasirinkimo sandoris, kurio pagrindinė priemonė yra akcija ar emitento įvykių nulemtas akcijų krepšelis RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = SHRS RTS23#26 arba, jei vertė nulis – RTS23#28	Laikoma, kad visų akcijų pasirinkimo sandorių rinka yra likvidi.

▼M3

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės	
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, taikomi šie metodai**
Akcijų ateities / išankstiniai sandoriai Ateities / išankstinis sandoris, kurio pagrindinė priemonė yra akcija ar emitento įvykių nulemtas akcijų krepšelis RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR arba FORW RTS2#27 = SHRS RTS23#26 arba, jei vertė nulis – RTS23#28	Laikoma, kad visų akcijų ateities / išankstinių sandorių rinka yra likvidi.
Akcijų dividendų pasirinkimo sandoriai Pasirinkimo sandoriai, susiję su konkrečios akcijos dividendais RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = DVSE RTS23#26 arba, jei vertė nulis – RTS23#28	Laikoma, kad visų akcijų dividendų pasirinkimo sandorių rinka yra likvidi.
Akcijų dividendų ateities / išankstiniai sandoriai Ateities / išankstinis sandoriai, susiję su konkrečios akcijos dividendais RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR arba FORW RTS2#27 = DVSE RTS23#26 arba, jei vertė nulis – RTS23#28	Laikoma, kad visų akcijų dividendų ateities / išankstinių sandorių rinka yra likvidi.

▼M3

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės	
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, taikomi šie metodai**
Dividendų indekso pasirinkimo sandoriai Pasirinkimo sandoris dėl indekso, kurį sudaro daugiau nei vienos akcijos dividendai RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = DIVI RTS23#26 arba, jei vertė nulis – RTS23#28	Laikoma, kad visų dividendų indekso pasirinkimo sandorių rinka yra likvidi.
Dividendų indekso ateities / išankstiniai sandoriai Ateities / išankstiniai sandoriai dėl indekso, kurį sudaro daugiau nei vienos akcijos dividendai RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR arba FORW RTS2#27 = DIVI RTS23#26 arba, jei vertė nulis – RTS23#28	Laikoma, kad visų dividendų indekso ateities / išankstinių sandorių rinka yra likvidi.
Kintamumo indekso pasirinkimo sandoriai Pasirinkimo sandoriai, kurių pagrindinė priemonė yra kintamumo indeksas, apibrėžiamas kaip indeksas, susijęs su nuosavybės finansinių priemonių konkretaus pagrindinio indekso svyravimu RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = VOLI RTS23#26 arba, jei vertė nulis – RTS23#28	Laikoma, kad visų kintamumo indekso pasirinkimo sandorių rinka yra likvidi.

▼M3

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės	
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, taikomi šie metodai**
Kintamumo indekso ateities / išankstiniai sandoriai Ateities / išankstiniai sandoriai, kurių pagrindinė priemonė yra kintamumo indeksas, apibrėžiamas kaip indeksas, susijęs su nuosavybės finansinių priemonių konkretaus pagrindinio indekso svyravimu RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR arba FORW RTS2#27 = VOLI RTS23#26 arba, jei vertė nulis – RTS23#28	Laikoma, kad visų kintamumo indekso ateities / išankstinių sandorių rinka yra likvidi.
Biržinių fondų pasirinkimo sandoriai Pasirinkimo sandoriai, kurių pagrindinė priemonė – biržinis fondas RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = ETFS RTS23#26 arba, jei vertė nulis – RTS23#28	Laikoma, kad visų biržinių fondų pasirinkimo sandorių rinka yra likvidi.
Biržinių fondų ateities / išankstiniai sandoriai Ateities / išankstiniai sandoriai, kurių pagrindinė priemonė – biržinis fondas RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR arba FORW RTS2#27 = ETFS RTS23#26 arba, jei vertė nulis – RTS23#28	Laikoma, kad visų biržinių fondų ateities / išankstinių sandorių rinka yra likvidi.

▼M3

<table>
<tr><th colspan="5">Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Turto poklasis</th><th colspan="3" rowspan="2">Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau</th><th colspan="2">Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų</th></tr>
<tr><th>Dienos tariamosios sumos vidurkis
[1 kiekybinis likvidumo kriterijus]</th><th>Sandorių skaičiaus dienos vidurkis
[2 kiekybinis likvidumo kriterijus]</th></tr>
<tr><td>Apsikeitimo sandoriai
RTS2#3 = DERV
RTS2#4 = EQUI
RTS2#5 = SWAP</td><td colspan="3">Apsikeitimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus:
1 segmentavimo kriterijus (RTS2#27) – pagrindinės priemonės rūšis: vienas pavadinimas, indeksas, krepšelis
2 segmentavimo kriterijus (RTS23#26 arba, jei vertė nulis – RTS23#28) – pagrindinės priemonės rūšis: vienas pavadinimas, indeksas, krepšelis
3 segmentavimo kriterijus (RTS2#28) – parametras: kainos grąžos pagrindinių rezultatų parametras, grąžos dividendų parametras, grąžos dispersijos parametras, grąžos kintamumo parametras
4 segmentavimo kriterijus (RTS2#8) – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:</td><td>50 000 000 EUR</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Kainos grąžos pagrindinis rezultatų parametras</td><td>Grąžos dispersijos / kintamumo parametras</td><td>Grąžos dividendų parametras</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn.</td><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn.</td><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>2 terminų intervalas: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn.</td><td>2 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn.</td><td>2 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>3 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn.</td><td>3 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td>3 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>4 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td>4 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td><td>…</td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

<table>
<tr><td colspan="5">Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Turto poklasis</td><td colspan="3" rowspan="2">Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau</td><td colspan="2">Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų</td></tr>
<tr><td>Dienos tariamosios sumos vidurkis
[1 kiekybinis likvidumo kriterijus]</td><td>Sandorių skaičiaus dienos vidurkis
[2 kiekybinis likvidumo kriterijus]</td></tr>
<tr><td rowspan="4"></td><td>5 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td><td>5 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai</td><td>m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai</td><td rowspan="4"></td><td rowspan="4"></td></tr>
<tr><td>6 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai</td><td>…</td><td></td></tr>
<tr><td>…</td><td>m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai</td><td></td></tr>
<tr><td>m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>Portfelio apsikeitimo sandoriai
RTS2#3 = DERV
RTS2#4 = EQUI
RTS2#5 = PSWP</td><td colspan="3">Portfelio apsikeitimo sandorių poklasiui būdingas specifinis derinys, kurį sudaro:
1 segmentavimo kriterijus (RTS2#27) – pagrindinės priemonės rūšis: vienas pavadinimas, indeksas, krepšelis
2 segmentavimo kriterijus (RTS23#26 arba, jei vertė nulis – RTS23#28) – pagrindinės priemonės rūšis: vienas pavadinimas, indeksas, krepšelis
3 segmentavimo kriterijus (RTS2#28) – parametras: kainos grąžos pagrindinių rezultatų parametras, grąžos dividendų parametras, grąžos dispersijos parametras, grąžos kintamumo parametras
4 segmentavimo kriterijus (RTS2#8) – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:
1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn.
2 terminų intervalas: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn.
3 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn.
4 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai
5 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai
6 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai
…
m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai</td><td>50 000 000 EUR</td><td>15</td></tr>
</table>

▼M3

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės	
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, taikomi šie metodai**
Kitos su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės Su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės, nepriklausančios nė vienam iš pirmiau išvardytų turto poklasių RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OTHR	Laikoma, kad bet kokių kitų su nuosavybės vertybiniais popieriais susietų išvestinių finansinių priemonių rinka nėra likvidi.

▼M4

6.2 lentelė

Su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės. Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės						
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo kiekvienas turto poklasis toliau skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribų vertės iki ir po sandorio sudarymo, nustatytos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, remiantis dienos tariamosios sumos vidurkio intervalu, į kurį poklasis patenka**			
			Dienos tariamosios sumos vidurkis	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
				Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Akcijų indekso pasirinkimo sandoriai	Akcijų indekso pasirinkimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinis akcijų indeksas	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	< 100 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 200 mln. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 600 mln. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 600 mln. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės						
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo kiekvienas turto poklasis toliau skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribų vertės iki ir po sandorio sudarymo, nustatytos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, remiantis dienos tariamosios sumos vidurkio intervalu, į kurį poklasis patenka**			
			Dienos tariamosios sumos vidurkis	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
				Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Akcijų indekso ateities / išankstiniai sandoriai	Akcijų indekso ateities / išankstinių sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinis akcijų indeksas	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	< 100 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 1 mlrd. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mlrd. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 3 mlrd. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mlrd. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 5 mlrd. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 5 mlrd. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Akcijų pasirinkimo sandoriai	Akcijų pasirinkimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinė akcija	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	< 5 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 10 mln. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 20 mln. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 20 mln. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės						
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo kiekvienas turto poklasis toliau skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribų vertės iki ir po sandorio sudarymo, nustatytos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, remiantis dienos tariamosios sumos vidurkio intervalu, į kurį poklasis patenka**			
			Dienos tariamosios sumos vidurkis	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
				Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Akcijų ateities / išankstiniai sandoriai	Akcijų ateities / išankstinių sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinė akcija	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	< 5 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 10 mln. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 20 mln. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 20 mln. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
Akcijų dividendų pasirinkimo sandoriai	Akcijų dividendų pasirinkimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinė akcija, suteikianti teisę į dividendus	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	< 5 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR
			5 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 10 mln. EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR
			10 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 20 mln. EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 20 mln. EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR

▼M4

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės						
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo kiekvienas turto poklasis toliau skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribų vertės iki ir po sandorio sudarymo, nustatytos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, remiantis dienos tariamosios sumos vidurkio intervalu, į kurį poklasis patenka**			
			Dienos tariamosios sumos vidurkis	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
				Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Akcijų dividendų ateities / išankstiniai sandoriai	Akcijų dividendų ateities / išankstinių sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinė akcija, suteikianti teisę į dividendus	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	< 5 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR
			5 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 10 mln. EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR
			10 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 20 mln. EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 20 mln. EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR
Dividendų indekso pasirinkimo sandoriai	Dividendų indekso pasirinkimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinis dividendų indeksas	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	< 100 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 200 mln. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 600 mln. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 600 mln. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės						
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo kiekvienas turto poklasis toliau skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribų vertės iki ir po sandorio sudarymo, nustatytos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, remiantis dienos tariamosios sumos vidurkio intervalu, į kurį poklasis patenka**			
			Dienos tariamosios sumos vidurkis	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
				Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Dividendų indekso ateities / išankstiniai sandoriai	Dividendų indekso ateities / išankstinių sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinis dividendų indeksas	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	< 100 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 1 mlrd. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mlrd. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 3 mlrd. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mlrd. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 5 mlrd. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 5 mlrd. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Kintamumo indekso pasirinkimo sandoriai	Kintamumo indekso pasirinkimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinis kintamumo indeksas	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	< 100 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 200 mln. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 600 mln. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 600 mln. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės						
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo kiekvienas turto poklasis toliau skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribų vertės iki ir po sandorio sudarymo, nustatytos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, remiantis dienos tariamosios sumos vidurkio intervalu, į kurį poklasis patenka**			
			Dienos tariamosios sumos vidurkis	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
				Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Kintamumo indekso ateities / išankstiniai sandoriai	Kintamumo indekso ateities / išankstinių sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinis kintamumo indeksas	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	< 100 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 1 mlrd. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mlrd. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 3 mlrd. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mlrd. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 5 mlrd. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 5 mlrd. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Biržinių fondų pasirinkimo sandoriai	Biržinių fondų pasirinkimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinis biržinis fondas	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	< 5 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 10 mln. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 20 mln. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 20 mln. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės						
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo kiekvienas turto poklasis toliau skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribų vertės iki ir po sandorio sudarymo, nustatytos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, remiantis dienos tariamosios sumos vidurkio intervalu, į kurį poklasis patenka**			
			Dienos tariamosios sumos vidurkis	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
				Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Biržinių fondų ateities / išankstiniai sandoriai	Biržinių fondų ateities / išankstinių sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinis biržinis fondas	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	< 5 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 10 mln. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 20 mln. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 20 mln. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
Apsikeitimo sandoriai	Apsikeitimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinės priemonės rūšis: vienas pavadinimas, indeksas, krepšelis **2 segmentavimo kriterijus** – pagrindinė vieno pavadinimo priemonė, indeksas, krepšelis **3 segmentavimo kriterijus** – parametras: kainos grąžos pagrindinių rezultatų parametras, grąžos dividendų parametras, grąžos dispersijos parametras, grąžos kintamumo parametras **4 segmentavimo kriterijus** – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	50 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 100 mln. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 200 mln. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 200 mln. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės								
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo kiekvienas turto poklasis toliau skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**			**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribų vertės iki ir po sandorio sudarymo, nustatytos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, remiantis dienos tariamosios sumos vidurkio intervalu, į kurį poklasis patenka**			
					Dienos tariamosios sumos vidurkis	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
						Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
	Kainos grąžos pagrindinių rezultatų parametras	Grąžos dispersijos / kintamumo parametras	Grąžos dividendų parametras					
	1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn.	1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn.	1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai					
	2 terminų intervalas: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn.	2 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn.	2 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai					
	3 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn.	3 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai	3 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai					
	4 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai	4 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai	…					

▼M4

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės								
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo kiekvienas turto poklasis toliau skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**			**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribų vertės iki ir po sandorio sudarymo, nustatytos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, remiantis dienos tariamosios sumos vidurkio intervalu, į kurį poklasis patenka**			
					Dienos tariamosios sumos vidurkis	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
						Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
	5 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai	5 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai	*m* terminų intervalas: (*n*-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ *n* metai					
	6 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai	…						
	…	*m* terminų intervalas: (*n*-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ *n* metai						
	m terminų intervalas: (*n*-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ *n* metai							
Portfelio apsikeitimo sandoriai	Portfelio apsikeitimo sandorių poklasiui būdingas specifinis derinys, kurį sudaro: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinės priemonės rūšis: vienas pavadinimas, indeksas, krepšelis **2 segmentavimo kriterijus** – pagrindinė vieno pavadinimo priemonė, indeksas, krepšelis **3 segmentavimo kriterijus** – parametras: kainos grąžos pagrindinių rezultatų parametras, grąžos dividendų parametras, grąžos dispersijos parametras, grąžos kintamumo parametras **4 segmentavimo kriterijus** – laikotarpis iki portfelio apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:			Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	50 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 100 mln. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
					100 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 200 mln. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
					Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 200 mln. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės						
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo kiekvienas turto poklasis toliau skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribų vertės iki ir po sandorio sudarymo, nustatytos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, remiantis dienos tariamosios sumos vidurkio intervalu, į kurį poklasis patenka**			
			Dienos tariamosios sumos vidurkis	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
				Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
	1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn. **2 terminų intervalas:** 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. **3 terminų intervalas:** 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. **4 terminų intervalas:** 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **5 terminų intervalas:** 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai **6 terminų intervalas:** 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … ***m* terminų intervalas:** (*n*-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ *n* metai					

6.3 lentelė

Su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės. Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos poklasiams, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka nėra likvidi**		
	Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Apsikeitimo sandoriai	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR
Portfelio apsikeitimo sandoriai	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR
Kitos su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR

▼B

7. **Biržos prekių išvestinės finansinės priemonės**

▼M3

7.1 lentelė

Biržos prekių išvestinės finansinės priemonės – klasės, kurių rinka nėra likvidi

<table>
<tr><td colspan="4">Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Turto poklasis</td><td rowspan="2" colspan="2">Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau</td><td colspan="2">Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų ribų</td></tr>
<tr><td>Dienos tariamosios sumos vidurkis
[1 kiekybinis likvidumo kriterijus]</td><td>Sandorių skaičiaus dienos vidurkis
[2 kiekybinis likvidumo kriterijus]</td></tr>
<tr><td>Biržos prekių – metalų ateities / išankstiniai sandoriai
RTS2#3 = DERV ir RTS2#4 = COMM ir RTS23#35 = METL ir [RTS2#5 = FUTR arba FORW]</td><td colspan="2">Biržos prekių – metalų ateities / išankstinių sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus:
1 segmentavimo kriterijus (RTS23#36) – metalo rūšis: taurusis metalas, netaurusis metalas
2 segmentavimo kriterijus (RTS23#37) – pagrindinis metalas
3 segmentavimo kriterijus (RTS2#15) – tariamosios sumos valiuta, apibrėžiama kaip valiuta, kuria denominuota ateities / išankstinio sandorio tariamoji suma
4 segmentavimo kriterijus (RTS2#8) – laikotarpis iki ateities / išankstinio sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:
<table>
<tr><th>Taurieji metalai</th><th>Netaurieji metalai</th></tr>
<tr><td>1 terminų intervalas:
0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn.</td><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td></tr>
<tr><td>2 terminų intervalas:
3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td>2 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td></tr>
<tr><td>3 terminų intervalas:
1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td><td>3 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai</td></tr>
</table></td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
</table>

▼M3

<table>
<tr><th colspan="4">Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Turto poklasis</th><th colspan="2" rowspan="2">Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau</th><th colspan="2">Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų ribų</th></tr>
<tr><th>Dienos tariamosios sumos vidurkis
[1 kiekybinis likvidumo kriterijus]</th><th>Sandorių skaičiaus dienos vidurkis
[2 kiekybinis likvidumo kriterijus]</th></tr>
<tr><td></td><td>4 terminų intervalas:
2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai</td><td>…</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>…</td><td>m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>Biržos prekių – metalų pasirinkimo sandoriai
RTS2#3 = DERV ir RTS2#4 = COMM ir RTS23#35 = METL ir RTS2#5 = OPTN</td><td colspan="2">Biržos prekių – metalų pasirinkimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus:
1 segmentavimo kriterijus (RTS23#36) – metalo rūšis: taurusis metalas, netaurusis metalas
2 segmentavimo kriterijus (RTS23#37) – pagrindinis metalas
3 segmentavimo kriterijus (RTS2#15) – tariamosios sumos valiuta, apibrėžiama kaip valiuta, kuria denominuota pasirinkimo sandorio tariamoji suma
4 segmentavimo kriterijus (RTS2#8) – laikotarpis iki pasirinkimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:</td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
<tr><td></td><td>Taurieji metalai</td><td>Netaurieji metalai</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>1 terminų intervalas:
0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn.</td><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>2 terminų intervalas:
3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td>2 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

<table>
<tr><th colspan="4">Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Turto poklasis</th><th colspan="2" rowspan="2">Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau</th><th colspan="2">Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų ribų</th></tr>
<tr><th>Dienos tariamosios sumos vidurkis
[1 kiekybinis likvidumo kriterijus]</th><th>Sandorių skaičiaus dienos vidurkis
[2 kiekybinis likvidumo kriterijus]</th></tr>
<tr><td rowspan="4"></td><td>3 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td><td>3 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai</td><td rowspan="4"></td><td rowspan="4"></td></tr>
<tr><td>4 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai</td><td>…</td></tr>
<tr><td>…</td><td>m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai</td></tr>
<tr><td>m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="6">Biržos prekių – metalų apsikeitimo sandoriai
RTS2#3 = DERV ir RTS2#4 = COMM ir RTS23#35 = METL ir RTS2#5 = SWAP</td><td colspan="2">Biržos prekių – metalų sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus:
1 segmentavimo kriterijus (RTS23#36) – metalo rūšis: taurusis metalas, netaurusis metalas
2 segmentavimo kriterijus (RTS23#37) – pagrindinis metalas
3 segmentavimo kriterijus (RTS2#15) – tariamosios sumos valiuta, apibrėžiama kaip valiuta, kuria denominuota apsikeitimo sandorio tariamoji suma
4 segmentavimo kriterijus (RTS23#34) – pateikimo būdas: pasirinktinai grynaisiais arba fizinis pateikimas
5 segmentavimo kriterijus (RTS2#8) – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:</td><td rowspan="6">10 000 000 EUR</td><td rowspan="6">10</td></tr>
<tr><td>Taurieji metalai</td><td>Netaurieji metalai</td></tr>
<tr><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn.</td><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td></tr>
<tr><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td colspan="2"></td></tr>
</table>

▼M3

Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės				
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**		**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų ribų**	
			Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
	2 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai	**2 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai		
	3 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai	**3 terminų intervalas**: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai		
	4 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai	…		
	…	**m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai		
	m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai			
Biržos prekių – energijos ateities / išankstiniai sandoriai RTS2#3 = DERV ir RTS2#4 = COMM ir RTS23#35 = NRGY ir [RTS2#5 = FUTR arba FORW]	Biržos prekių – energijos ateities / išankstinių sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#36) – energijos rūšis: nafta, distiliatai, anglys, lengvieji distiliatai, gamtinės dujos, elektra, kelių formų energija **2 segmentavimo kriterijus** (RTS23#37) – pagrindinė energijos prekė **3 segmentavimo kriterijus** (RTS2#15) – tariamosios sumos valiuta, apibrėžiama kaip valiuta, kuria denominuota ateities / išankstinio sandorio tariamoji suma **4 segmentavimo kriterijus** — [išbraukta]		10 000 000 EUR	10

▼M3

<table>
<tr><td colspan="5">Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Turto poklasis</td><td colspan="3" rowspan="2">Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau</td><td colspan="2">Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų ribų</td></tr>
<tr><td>Dienos tariamosios sumos vidurkis
[1 kiekybinis likvidumo kriterijus]</td><td>Sandorių skaičiaus dienos vidurkis
[2 kiekybinis likvidumo kriterijus]</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="3">5 segmentavimo kriterijus (RTS2#14) – pateikimo / atsiskaitymo grynaisiais vieta, taikytina visų rūšių energijai
6 segmentavimo kriterijus (RTS2#8) – laikotarpis iki ateities / išankstinio sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Nafta / distiliatai / lengvieji distiliatai</td><td>Anglys</td><td>Gamtinės dujos / elektra/ kelių formų energija</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>1 terminų intervalas:
0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 4 mėn.</td><td>1 terminų intervalas:
0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn.</td><td>1 terminų intervalas:
0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn.</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>2 terminų intervalas:
4 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 8 mėn.</td><td>2 terminų intervalas:
6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td>2 terminų intervalas:
1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>3 terminų intervalas:
8 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td>3 terminų intervalas:
1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td><td>3 terminų intervalas:
1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>4 terminų intervalas:
1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td><td>…</td><td>…</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>…</td><td>m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai</td><td>m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai</td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

<table>
<tr><th colspan="5">Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Turto poklasis</th><th colspan="3" rowspan="2">Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau</th><th colspan="2">Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų ribų</th></tr>
<tr><th>Dienos tariamosios sumos vidurkis
[1 kiekybinis likvidumo kriterijus]</th><th>Sandorių skaičiaus dienos vidurkis
[2 kiekybinis likvidumo kriterijus]</th></tr>
<tr><td>Biržos prekių – energijos pasirinkimo sandoriai
RTS2#3 = DERV ir RTS2#4 = COMM ir RTS23#35 = NRGY ir RTS2#5 = OPTN</td><td colspan="3">Biržos prekių – energijos pasirinkimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus:
1 segmentavimo kriterijus (RTS23#36) – energijos rūšis: nafta, distiliatai, anglys, lengvieji distiliatai, gamtinės dujos, elektra, kelių formų energija
2 segmentavimo kriterijus (RTS23#37) – pagrindinė energijos prekė
3 segmentavimo kriterijus (RTS2#15) – tariamosios sumos valiuta, apibrėžiama kaip valiuta, kuria denominuota pasirinkimo sandorio tariamoji suma
4 segmentavimo kriterijus — [išbraukta]
5 segmentavimo kriterijus (RTS2#14) – pateikimo / atsiskaitymo grynaisiais vieta, taikytina visų rūšių energijai
6 segmentavimo kriterijus (RTS2#8) – laikotarpis iki pasirinkimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:</td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
<tr><td></td><td>Nafta / distiliatai / lengvieji distiliatai</td><td>Anglys</td><td>Gamtinės dujos / elektra/ kelių formų energija</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>1 terminų intervalas:
0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 4 mėn.</td><td>1 terminų intervalas:
0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn.</td><td>1 terminų intervalas:
0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn.</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>2 terminų intervalas:
4 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 8 mėn.</td><td>2 terminų intervalas:
6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td>2 terminų intervalas:
1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės					
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**			**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų ribų**	
				Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
	3 terminų intervalas: 8 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai	**3 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai	**3 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai		
	4 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai	…	…		
	…	**m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	**m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai		
	m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai				
Biržos prekių – energijos apsikeitimo sandoriai RTS2#3 = DERV ir RTS2#4 = COMM ir RTS23#35 = NRGY ir RTS2#5 = SWAP	Biržos prekių – energijos apsikeitimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#36) – energijos rūšis: nafta, distiliatai, anglys, lengvieji distiliatai, gamtinės dujos, elektra, kelių formų energija **2 segmentavimo kriterijus** (RTS23#37) – pagrindinė energijos prekė **3 segmentavimo kriterijus** (RTS2#15) – tariamosios sumos valiuta, apibrėžiama kaip valiuta, kuria denominuota apsikeitimo sandorio tariamoji suma **4 segmentavimo kriterijus** (RTS23#34) – pateikimo būdas: pasirinktinai grynaisiais arba fizinis pateikimas **5 segmentavimo kriterijus** — [išbraukta] **6 segmentavimo kriterijus** (RTS2#14) – pateikimo / atsiskaitymo grynaisiais vieta, taikytina visų rūšių energijai **7 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:			10 000 000 EUR	10

▼M3

Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės					
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**			**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų ribų**	
				Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
	Nafta / distiliatai / lengvieji distiliatai	**Anglys**	**Gamtinės dujos / elektra / kelių formų energija**		
	1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 4 mėn.	**1 terminų intervalas**: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn.	**1 terminų intervalas**: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn.		
	2 terminų intervalas: 4 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 8 mėn.	**2 terminų intervalas**: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai	**2 terminų intervalas:** 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai		
	3 terminų intervalas: 8 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai	**3 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai	**3 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai		
	4 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai	…	…		
	…	**m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	**m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai		
	m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai				
Biržos prekių – žemės ūkio produktų ateities / išankstiniai sandoriai RTS2#3 = DERV ir RTS2#4 = COMM ir RTS23#35 = AGRI ir [RTS2#5 = FUTR arba FORW]	Biržos prekių – žemės ūkio produktų ateities / išankstinių sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#36 ir RTS23#37) – pagrindinė žemės ūkio biržos prekė (prekės pakategorė ir papildoma prekės pakategorė) **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#15) – tariamosios sumos valiuta, apibrėžiama kaip valiuta, kuria denominuota ateities / išankstinio sandorio tariamoji suma			10 000 000 EUR	10

▼M3

Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų ribų**	
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
	3 segmentavimo kriterijus (RTS2#8) – laikotarpis iki ateities / išankstinio sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas**: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. **2 terminų intervalas**: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. **3 terminų intervalas**: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **4 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai … **m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai		
Biržos prekių – žemės ūkio produktų pasirinkimo sandoriai RTS2#3 = DERV ir RTS2#4 = COMM ir RTS23#35 = AGRI ir RTS2#5 = OPTN	Biržos prekių – žemės ūkio produktų pasirinkimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#36 ir RTS23#37) – pagrindinė žemės ūkio biržos prekė (prekės pakategorė ir papildoma prekės pakategorė) **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#15) – tariamosios sumos valiuta, apibrėžiama kaip valiuta, kuria denominuota pasirinkimo sandorio tariamoji suma **3 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki pasirinkimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas**: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. **2 terminų intervalas**: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. **3 terminų intervalas**: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **4 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai … **m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	10 000 000 EUR	10

▼M3

Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų ribų**	
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
Biržos prekių – žemės ūkio produktų apsikeitimo sandoriai RTS2#3 = DERV ir RTS2#4 = COMM ir RTS23#35 = AGRI ir RTS2#5 = SWAP	Biržos prekių – žemės ūkio produktų apsikeitimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#36 ir RTS23#37) – pagrindinė žemės ūkio biržos prekė (prekės pakategorė ir papildoma prekės pakategorė) **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#15) – tariamosios sumos valiuta, apibrėžiama kaip valiuta, kuria denominuota apsikeitimo sandorio tariamoji suma **3 segmentavimo kriterijus** (RTS23#34) – pateikimo būdas: pasirinktinai grynaisiais arba fizinis pateikimas **4 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas**: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. **2 terminų intervalas**: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. **3 terminų intervalas**: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **4 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai … **m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	10 000 000 EUR	10
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, taikomi šie metodai**		
Kitų biržos prekių išvestinės finansinės priemonės Biržos prekių išvestinės finansinės priemonės, nepriklausančios nė vienam iš pirmiau išvardytų turto poklasių	Laikoma, kad visų kitų biržos prekių išvestinių finansinių priemonių rinka nėra likvidi.		

▼M4

7.2 lentelė

Biržos prekių išvestinės finansinės priemonės. Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos poklasiams, kurių rinka yra likvidi

Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės									
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka yra likvidi**								
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Biržos prekių – metalų ateities / išankstiniai sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Biržos prekių – metalų pasirinkimo sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Biržos prekių – metalų apsikeitimo sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

▼M4

Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės									
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka yra likvidi**								
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Biržos prekių – energijos ateities / išankstiniai sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Biržos prekių – energijos pasirinkimo sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Biržos prekių – energijos apsikeitimo sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

▼M4

Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės									
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka yra likvidi**								
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Biržos prekių – žemės ūkio produktų ateities / išankstiniai sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Biržos prekių – žemės ūkio produktų pasirinkimo sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Biržos prekių – žemės ūkio produktų apsikeitimo sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

▼M4

7.3 lentelė

Biržos prekių išvestinės finansinės priemonės. Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos poklasiams, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka nėra likvidi**		
	Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Biržos prekių – metalų ateities / išankstiniai sandoriai	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Biržos prekių – metalų pasirinkimo sandoriai	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Biržos prekių – metalų apsikeitimo sandoriai	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Biržos prekių – energijos ateities / išankstiniai sandoriai	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Biržos prekių – energijos pasirinkimo sandoriai	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Biržos prekių – energijos apsikeitimo sandoriai	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Biržos prekių – žemės ūkio produktų ateities / išankstiniai sandoriai	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Biržos prekių – žemės ūkio produktų pasirinkimo sandoriai	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Biržos prekių – žemės ūkio produktų apsikeitimo sandoriai	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Kitų biržos prekių išvestinės finansinės priemonės	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR

▼B

8. **Užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės**

▼M3

8.1 lentelė

Užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės– klasės, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės			
Finansinė priemonė, susijusi su valiutomis, kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES I priedo C skirsnio 4 punkte.			
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų**	
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
Išankstiniai sandoriai be apsikeitimo pagrindine suma Išankstinis sandoris, pagal kurio sąlygas sandorio šalys atsiskaito grynaisiais, o atsiskaitymo suma lygi dviejų valiutų kursų sandorio dieną ir vertinimo dieną skirtumui. Atsiskaitymo dieną viena šalis turės kitai sumokėti grynąjį i) sandorio dieną nustatyto valiutos kurso ir ii) vertinimo dienos valiutos kurso skirtumą, remiantis tariamąja suma, ir ši suma yra mokėtina sutartyje nustatyta atsiskaitymo valiuta. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FORW RTS2#26 = NDLV	Išankstinių užsienio valiutos keitimo sandorių be apsikeitimo pagrindine suma poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#13 ir RTS23#47) – pagrindinė valiutų pora, apibrėžiama kaip dviejų pagrindinių valiutų, kuriomis grindžiama sutartis dėl išvestinių finansinių priemonių, derinys **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki išankstinio sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas**: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 sav. **2 terminų intervalas**: 1 sav. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. **3 terminų intervalas**: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **4 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai **5 terminų intervalas**: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … **m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	Laikoma, kad išankstinių sandorių be apsikeitimo pagrindine suma rinka nėra likvidi.	

▼M3

Turto klasė – užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų**	
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
Išankstiniai sandoriai su apsikeitimu pagrindine suma Išankstiniai sandoriai, kuriuos vykdant konkrečią sutartyje nustatytą atsiskaitymo dieną tik apsikeičiama dviem skirtingomis valiutomis fiksuotu kursu, dėl kurio susitarta sudarant sutartį dėl apsikeitimo. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FORW RTS2#26 = DLVB	Išankstinių užsienio valiutos keitimo sandorių su apsikeitimu pagrindine suma poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#13 ir RTS23#47) – pagrindinė valiutų pora, apibrėžiama kaip dviejų pagrindinių valiutų, kuriomis grindžiama sutartis dėl išvestinių finansinių priemonių, derinys **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki išankstinio sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas**: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 sav. **2 terminų intervalas**: 1 sav. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. **3 terminų intervalas**: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **4 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai **5 terminų intervalas**: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … **m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	Laikoma, kad išankstinių sandorių su apsikeitimu pagrindine suma rinka nėra likvidi.	

▼M3

Turto klasė – užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų**	
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
Užsienio valiutos pasirinkimo sandoriai be apsikeitimo pagrindine suma Pasirinkimo sandoriai, pagal kuriuos sandorio šalys atsiskaito grynaisiais, o atsiskaitymo suma lygi dviejų valiutų kursų sandorio dieną ir vertinimo dieną skirtumui. Atsiskaitymo dieną viena šalis turės kitai sumokėti grynąjį i) sandorio dieną nustatyto valiutos kurso ir ii) vertinimo dienos valiutos kurso skirtumą, remiantis tariamąja suma, ir ši suma yra mokėtina sutartyje nustatyta atsiskaitymo valiuta. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = OPTN RTS2#26 = NDLV	Užsienio valiutos pasirinkimo sandorių be apsikeitimo pagrindine suma poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#13 ir RTS23#47) – pagrindinė valiutų pora, apibrėžiama kaip dviejų pagrindinių valiutų, kuriomis grindžiama sutartis dėl išvestinių finansinių priemonių, derinys **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki pasirinkimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas**: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 sav. **2 terminų intervalas**: 1 sav. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. **3 terminų intervalas**: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **4 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai **5 terminų intervalas**: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … **m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	Laikoma, kad užsienio valiutos pasirinkimo sandorių be apsikeitimo pagrindine suma rinka nėra likvidi.	

▼M3

Turto klasė – užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų**	
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
Užsienio valiutos pasirinkimo sandoriai su apsikeitimu pagrindine suma Pasirinkimo sandoriai, kuriuos vykdant konkrečią sutartyje nustatytą atsiskaitymo dieną tik apsikeičiama dviem skirtingomis valiutomis fiksuotu kursu, dėl kurio susitarta sudarant sutartį dėl apsikeitimo. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = OPTN RTS2#26 = DLVB	Užsienio valiutos pasirinkimo sandorių su apsikeitimu pagrindine suma poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#13 ir RTS23#47) – pagrindinė valiutų pora, apibrėžiama kaip dviejų pagrindinių valiutų, kuriomis grindžiama sutartis dėl išvestinių finansinių priemonių, derinys **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki pasirinkimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas**: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 sav. **2 terminų intervalas**: 1 sav. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. **3 terminų intervalas**: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **4 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai **5 terminų intervalas**: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … **m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	Laikoma, kad užsienio valiutos pasirinkimo sandorių su apsikeitimu pagrindine suma rinka nėra likvidi.	

▼M3

Turto klasė – užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų**	
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
Užsienio valiutos apsikeitimo sandoriai be apsikeitimo pagrindine suma Apsikeitimo sandoriai, pagal kuriuos sandorio šalys atsiskaito grynaisiais, o atsiskaitymo suma lygi dviejų atitinkamų valiutų kursų sandorio dieną ir vertinimo dieną skirtumui. Atsiskaitymo dieną viena šalis turės kitai sumokėti grynąjį i) sandorio dieną nustatyto valiutos kurso ir ii) vertinimo dienos valiutos kurso skirtumą, remiantis tariamąja suma, ir ši suma yra mokėtina sutartyje nustatyta atsiskaitymo valiuta. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = SWAP RTS2#26 = NDLV	Užsienio valiutos apsikeitimo sandorių be apsikeitimo pagrindine suma poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#13 ir RTS23#47) – pagrindinė valiutų pora, apibrėžiama kaip dviejų pagrindinių valiutų, kuriomis grindžiama sutartis dėl išvestinių finansinių priemonių, derinys **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas**: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 sav. **2 terminų intervalas**: 1 sav. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. **3 terminų intervalas**: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **4 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai **5 terminų intervalas**: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … **m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	Laikoma, kad užsienio valiutos apsikeitimo sandorių be apsikeitimo pagrindine suma rinka nėra likvidi.	

▼M3

Turto klasė – užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų**	
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
Užsienio valiutos apsikeitimo sandoriai su apsikeitimu pagrindine suma Apsikeitimo sandoriai, kai konkrečią sutartyje nustatytą atsiskaitymo dieną tik apsikeičiama dviem skirtingomis valiutomis fiksuotu kursu, dėl kurio susitarta sudarant sutartį dėl apsikeitimo. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = SWAP RTS2#26 = DLVB	Užsienio valiutos apsikeitimo sandorių su apsikeitimu pagrindine suma poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#13 ir RTS23#47) – pagrindinė valiutų pora, apibrėžiama kaip dviejų pagrindinių valiutų, kuriomis grindžiama sutartis dėl išvestinių finansinių priemonių, derinys **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas**: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 sav. **2 terminų intervalas**: 1 sav. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. **3 terminų intervalas**: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **4 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai **5 terminų intervalas**: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … **m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	Laikoma, kad užsienio valiutos apsikeitimo sandorių su apsikeitimu pagrindine suma rinka nėra likvidi.	

▼M3

Turto klasė – užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų**	
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
Užsienio valiutos ateities sandoriai **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = FUTR	Užsienio valiutos ateities sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#13 ir RTS23#47) – pagrindinė valiutų pora, apibrėžiama kaip dviejų pagrindinių valiutų, kuriomis grindžiama sutartis dėl išvestinių finansinių priemonių, derinys **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki ateities sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas**: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 sav. **2 terminų intervalas**: 1 sav. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. **3 terminų intervalas**: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **4 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai **5 terminų intervalas**: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … **m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	laikoma, kad užsienio valiutos ateities sandorių rinka nėra likvidi	

Turto klasė – užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės	
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, taikomi šie metodai**
Kitos užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės Užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės, neprikla-usančios nė vienam iš pirmiau išvardytų turto poklasių RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = OTHR	Laikoma, kad kitų užsienio valiutos išvestinių finansinių priemonių rinka nėra likvidi.

▼M4

8.2 lentelė

Užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės. Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos poklasiams, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka nėra likvidi**		
	Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Išankstiniai sandoriai be apsikeitimo pagrindine suma	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Išankstiniai sandoriai su apsikeitimu pagrindine suma	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Užsienio valiutos pasirinkimo sandoriai be apsikeitimo pagrindine suma	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Užsienio valiutos pasirinkimo sandoriai su apsikeitimu pagrindine suma	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Užsienio valiutos apsikeitimo sandoriai be apsikeitimo pagrindine suma	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Užsienio valiutos apsikeitimo sandoriai su apsikeitimu pagrindine suma	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Užsienio valiutos ateities sandoriai	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Kitos užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR

▼B

9. **Kredito išvestinės finansinės priemonės**

▼M3

9.1 lentelė

Kredito išvestinės finansinės priemonės – klasės, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – kredito išvestinės finansinės priemonės				
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Aktualiausios indekso versijos statusas** [Papildomas kokybinis likvidumo kriterijus]
Į indeksą įtrauktas kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris Apsikeitimo sandoris, pagal kurį vykdomas apsikeitimas pinigų srautais siejamas su keleto emitentų, leidžiančių indeksą sudarančias finansines priemones, kreditingumu ir kredito įvykių įvykimu **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	Į indeksą įtrauktų kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS2#34) – pagrindinis indeksas **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#42) – tariamosios sumos valiuta, apibrėžiama kaip valiuta, kuria denominuota išvestinės finansinės priemonės tariamoji suma **3 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikas iki kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas**: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **2 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai **3 terminų intervalas**: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … **m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	200 000 000 EUR	10	Laikoma, kad pagrindinio indekso rinka yra likvidi: (1) visą aktualiausios indekso versijos statuso galiojimo laikotarpį; (2) pirmąsias 30 darbo dienų indekso statusui pasikeitus į paskutinės ankstesnės versijos statusą. Aktualiausios versijos indeksas (angl. *on-the-run*) naujausia atnaujinama indekso versija (serija), parengta tą dieną, kai įsigalioja indekso sudėtis, ir pasibaigianti paskutinę dieną prieš datą, kurią įsigalioja kitos versijos (serijos) indekso sudėtis. Paskutinės ankstesnės versijos statusas (angl. *1x off-the-run status*) – indekso versija (serija), po kurios iš karto sekė esamas aktualiausios versijos (serijos) indeksas, tam tikru laiko momentu. Versija (serija) netenka aktualiausios versijos statuso ir įgyja paskutinės ankstesnės versijos statusą, kai parengiama naujausia indekso versija (serija).

▼M3

Turto klasė – kredito išvestinės finansinės priemonės				
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Aktualiausios indekso versijos statusas** [Papildomas kokybinis likvidumo kriterijus]
Vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriai Apsikeitimo sandoriai, pagal kuriuos vykdomas apsikeitimas pinigų srautais siejamas su vieno emitento, leidžiančio finansines priemones, kreditingumu ir kredito įvykių įvykimu **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	Vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų nevykdymo apsikeitimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS2#41) – pagrindinis referencinis subjektas **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#39) – pagrindinio referencinio subjekto tipas, apibrėžtas taip: valstybinio ir viešojo tipo emitentas vienas iš toliau išvardytų emisiją vykdančių subjektų: (a) Sąjunga; (b) valstybė narė, įskaitant valstybės narės Vyriausybės departamentus, įstaigas ar specialiosios paskirties įmones; (c) a ir b punktuose nenurodytas valstybės subjektas; (d) federacinės valstybės narės atveju – tos federacijos narė; (e) kelių valstybių narių specialiosios paskirties subjektas; (f) tarptautinė finansų įstaiga, įsteigta dviejų ar daugiau valstybių narių, siekiančių sutelkti finansavimą ir suteikti finansinę pagalbą savo nariams, kurie patiria ar kuriems gresia rimtos finansinės problemos;	10 000 000 EUR	10	

▼M3

Turto klasė – kredito išvestinės finansinės priemonės				
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Aktualiausios indekso versijos statusas** [Papildomas kokybinis likvidumo kriterijus]
	(g) Europos investicijų bankas; (h) viešasis subjektas, kuris nėra a–c punktuose nurodytas valstybės skolos vertybinių popierių emitentas; įmonių tipo emitentas emitentas, kuris nėra valstybinio ir viešojo tipo emitentas. **3 segmentavimo kriterijus** (RTS2#42) – tariamosios sumos valiuta, apibrėžiama kaip valiuta, kuria denominuota išvestinės finansinės priemonės tariamoji suma **4 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių terminų intervalo apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas**: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **2 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai **3 terminų intervalas**: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … **m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai			

Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka toliau nurodyto kokybinio likvidumo kriterijaus**
Pasirinkimo sandoriai, susiję su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu Pasirinkimo sandoriai, kurių pagrindinė priemonė yra kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksas	Pasirinkimo sandorių, susijusių su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus:	Pasirinkimo sandorio, susijusio su pagrindiniu kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, priklausančiu poklasiui, kurio rinka laikoma likvidžia ir kurio laikotarpis iki terminų intervalo yra 0–6 mėn., rinka yra likvidi

▼M3

Turto klasė – kredito išvestinės finansinės priemonės				
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Aktualiausios indekso versijos statusas** [Papildomas kokybinis likvidumo kriterijus]
RTS2#3 = DERV **RTS2#4 = CRDT**	**1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#26) – kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indekso poklasis, nustatytas į indeksą įtrauktų kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių poklasiui **2 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki pasirinkimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas**: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. **2 terminų intervalas**: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **3 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai **4 terminų intervalas**: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … **m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	Pasirinkimo sandorio, susijusio su pagrindiniu kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, priklausančiu poklasiui, kurio rinka laikoma likvidžia ir kurio laikotarpis iki terminų intervalo nėra 0–6 mėn., rinka nėra likvidi Pasirinkimo sandorio, susijusio su pagrindiniu kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, priklausančiu poklasiui, kurio rinka laikoma nelikvidžia, rinka nėra likvidi jokiu metu iki terminų intervalo		
Pasirinkimo sandoriai, susiję su vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriais Pasirinkimo sandoriai, kurių pagrindinė priemonė yra vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	Pasirinkimo sandorių, susijusių su vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriais, poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS23#26) – vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorio poklasis, nustatytas vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorio turto poklasiui	pasirinkimo sandorio, susijusio su vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriais, kurio pagrindinis vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris priklauso poklasiui, kurio rinka laikoma likvidžia ir kurio laikotarpis iki terminų intervalo yra 0–6 mėn., rinka yra likvidi; pasirinkimo sandorio, susijusio su vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriais, kurio pagrindinis vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris priklauso poklasiui, kurio rinka laikoma likvidžia ir kurio laikotarpis iki terminų intervalo nėra 0–6 mėn., rinka nėra likvidi;		

▼M3

Turto klasė – kredito išvestinės finansinės priemonės				
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Aktualiausios indekso versijos statusas** [Papildomas kokybinis likvidumo kriterijus]
	2 segmentavimo kriterijus (RTS2#8) – laikotarpis iki pasirinkimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas**: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn **2 terminų intervalas**: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **3 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai **4 terminų intervalas**: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … **m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	pasirinkimo sandorio, susijusio su vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriais, kurio pagrindinis vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris priklauso poklasiui, kurio rinka laikoma nelikvidžia, rinka nėra likvidi jokiu metu iki terminų intervalo.		

Turto klasė – kredito išvestinės finansinės priemonės	
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, taikomi šie metodai**
Kitos kredito išvestinės finansinės priemonės Kredito išvestinės finansinės priemonės, nepriklausančios nė vienam iš pirmiau išvardytų turto poklasių **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT** RTS2#5 = OTHR	Laikoma, kad kitų kredito išvestinių finansinių priemonių rinka nėra likvidi.

▼M4

9.2 lentelė

Kredito išvestinės finansinės priemonės. Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos poklasiams, kurių rinka yra likvidi

Turto klasė – kredito išvestinės finansinės priemonės									
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka yra likvidi**								
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Į indeksą įtrauktas kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Pasirinkimo sandoriai, susiję su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Turto klasė – kredito išvestinės finansinės priemonės									
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka yra likvidi**								
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

9.3 lentelė

Kredito išvestinės finansinės priemonės. Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos poklasiams, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – kredito išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka nėra likvidi**		
	Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Į indeksą įtrauktas kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Pasirinkimo sandoriai, susiję su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriai	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Kitos kredito išvestinės finansinės priemonės	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR

▼B

10. **C10 išvestinės finansinės priemonės**

▼M3

10.1 lentelė

C10 išvestinės finansinės priemonės– klasės, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – C10 išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų**	
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
Frachto išvestinės finansinės priemonės Finansinė priemonė, susijusi su frachto tarifais, kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES I priedo C skirsnio 10 punkte RTS2#3 = DERV ir RTS2#4 = COMM ir RTS23#35 = FRGT	Frachto išvestinių finansinių priemonių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** (RTS2#5) – sutarties rūšis: dėl ateities sandorių arba pasirinkimo sandorių **2 segmentavimo kriterijus** (RTS23#36) – frachto rūšis **3 segmentavimo kriterijus** (RTS2#37) – frachto porūšis **4 segmentavimo kriterijus** (RTS2#12) – dydžio nurodymas pagal frachto porūšį **5 segmentavimo kriterijus** (RTS2#13) – konkretus maršrutas arba laivo frachtavimo tam tikram laikui vidurkis **6 segmentavimo kriterijus** (RTS2#8) – laikotarpis iki išvestinės finansinės priemonės terminų intervalo, apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas**: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn. **2 terminų intervalas**: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn. **3 terminų intervalas**: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. **4 terminų intervalas**: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 9 mėn. **5 terminų intervalas**: 9 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **6 terminų intervalas**: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai	10 000 000 EUR	10

▼M3

Turto klasė – C10 išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų**	
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
	7 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … **m terminų intervalas**: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai		

Turto klasė – C10 išvestinės finansinės priemonės	
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, taikomi šie metodai**
Kitos C10 išvestinės finansinės priemonės Direktyvos 2014/65/ES I priedo C skirsnio 10 punkte apibrėžtos finansinės priemonės, kurios nėra frachto išvestinė finansinė priemonė, o bet kuris iš toliau nurodytų palūkanų normų išvestinių finansinių priemonių turto poklasių: apsikeitimo infliacijos rizika keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo sandoriai ir ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo infliacijos rizika keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo sandorių, apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandoriai, ateities / išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandorių ir bet kuris iš šių su nuosavybės vertybiniais popieriais susietų išvestinių finansinių priemonių turto poklasių: kintamumo indekso pasirinkimo sandoriai, kintamumo indekso ateities / išankstiniai sandoriai, grąžos dispersijos parametro apsikeitimo sandoriai, grąžos kintamumo parametro apsikeitimo sandoriai, grąžos dispersijos parametro portfelio apsikeitimo sandoriai ir grąžos kintamumo parametro portfelio apsikeitimo sandoriai	Laikoma, kad kitų C10 išvestinių finansinių priemonių rinka nėra likvidi.

▼M4

10.2 lentelė

C10 išvestinės finansinės priemonės. Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos poklasiams, kurių rinka yra likvidi

Turto klasė – C10 išvestinės finansinės priemonės									
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka yra likvidi**								
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Frachto išvestinės finansinės priemonės	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	70	50 000 EUR	80	60	75 000 EUR	90	70	100 000 EUR

10.3 lentelė

C10 išvestinės finansinės priemonės – priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos poklasiams, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – C10 išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka nėra likvidi**		
	Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Frachto išvestinės finansinės priemonės	50 000 EUR	75 000 EUR	100 000 EUR
Kitos C10 išvestinės finansinės priemonės	50 000 EUR	75 000 EUR	100 000 EUR

▼B

11. **Finansiniai sandoriai dėl kainų skirtumo**

▼M3

11.1 lentelė

Sandoriai dėl kainų skirtumo – klasės, kurių rinka nėra likvidi

Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	Kokybinis likvidumo kriterijus	**Dienos tariamosios sumos vidurkis** [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
Valiutos sandoriai dėl kainų skirtumo RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = CURR	Valiutos sandorių dėl kainų skirtumo poklasis apibrėžiamas pagal pagrindinių valiutų porą, kuri apibrėžiama kaip sandorių dėl kainų skirtumo ar kainų skirtumų lažybų sandorių dviejų pagrindinių valiutų derinys. RTS2#30 ir RTS2#31		50 000 000 EUR	100
Biržos prekės Sandoriai dėl kainų skirtumo RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = COMM	Biržos prekių sandorių dėl kainų skirtumo poklasis apibrėžiamas pagal sandorių dėl kainų skirtumo ar kainų skirtumų lažybų sandorių pagrindinę biržos prekę. RTS23#35 ir RTS23#36 ir RTS23#37		50 000 000 EUR	100
Nuosavybės vertybinių popierių sandoriai dėl kainų skirtumo RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = EQUI	Nuosavybės vertybinių popierių sandorių dėl kainų skirtumo poklasis apibrėžiamas pagal sandorių dėl kainų skirtumo ar kainų skirtumų lažybų sandorių pagrindinį nuosavybės vertybinį popierių. RTS23#26	Nuosavybės vertybinių popierių sandorių dėl kainų skirtumo rinka laikoma likvidžia, jei pagrindinė priemonė yra nuosavybės vertybinis popierius, kurio rinka yra likvidi, kaip nustatyta remiantis Reglamento (ES) Nr. 600/2014 2 straipsnio 1 dalies 17 punkto b papunkčiu.		
Obligacijų sandoriai dėl kainų skirtumo RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = BOND	Obligacijų sandorių dėl kainų skirtumo poklasis apibrėžiamas pagal sandorių dėl kainų skirtumo ar kainų skirtumų lažybų sandorių pagrindinę obligaciją ar obligacijų ateities sandorį. RTS23#26	Obligacijų sandorių dėl kainų skirtumo rinka laikoma likvidžia, jei pagrindinė priemonė yra obligacija ar obligacijų ateities sandoris, kurių rinka yra likvidi, kaip nustatyta remiantis 6 straipsniu ir 8 straipsnio 1 dalies b punktu.		

▼M3

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau	Kokybinis likvidumo kriterijus	Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	Sandorių skaičiaus dienos vidurkis [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
Sandoriai dėl kainų skirtumo, susiję su nuosavybės vertybinių popierių ateities / išankstiniais sandoriais RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = FTEQ	Sandorių dėl kainų skirtumo, susijusių su nuosavybės vertybinių popierių ateities / išankstiniais sandoriais, poklasis apibrėžiamas pagal pagrindinį ateities / išankstinį sandorį, susijusį su sandorių dėl kainų skirtumo ar kainų skirtumų lažybų sandorių nuosavybės vertybiniu popieriumi. RTS23#26	Laikoma, kad sandorių dėl kainų skirtumo, susijusių su nuosavybės vertybinių popierių ateities / išankstiniais sandoriais, rinka yra likvidi, jei pagrindinė priemonė yra nuosavybės vertybinių popierių ateities / išankstinis sandoris, kurio rinka yra likvidi, kaip nustatyta remiantis 6 straipsniu ir 8 straipsnio 1 dalies b punktu.		
Sandoriai dėl kainų skirtumo, susiję su nuosavybės vertybinių popierių pasirinkimo sandoriais RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OPEQ	Sandorių dėl kainų skirtumo, susijusių su nuosavybės vertybinių popierių pasirinkimo sandoriais, poklasis apibrėžiamas pagal pagrindinį pasirinkimo sandorį, susijusį su sandorių dėl kainų skirtumo ar kainų skirtumų lažybų sandorių nuosavybės vertybiniu popieriumi. RTS23#26	Laikoma, kad sandorių dėl kainų skirtumo, susijusių su nuosavybės vertybinių popierių pasirinkimo sandoriais, rinka yra likvidi, jei pagrindinė priemonė yra nuosavybės vertybinių popierių pasirinkimo sandoris, kurio rinka yra likvidi, kaip nustatyta remiantis 6 straipsniu ir 8 straipsnio 1 dalies b punktu.		

Turto klasė – finansiniai sandoriai dėl kainų skirtumo

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, taikomi šie metodai
Kiti sandoriai dėl kainų skirtumo	
Sandoriai dėl kainų skirtumo ar kainų skirtumų lažybų sandoriai, nepriklausantys nė vienam iš pirmiau išvardytų turto poklasių RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OTHR	Laikoma, kad kitų sandorių dėl kainų skirtumo ar kainų skirtumų lažybų sandorių rinka nėra likvidi.

▼M4

11.2 lentelė

Finansiniai sandoriai dėl kainų skirtumo. Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos poklasiams, kurių rinka yra likvidi

Turto klasė – finansiniai sandoriai dėl kainų skirtumo									
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka yra likvidi**								
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Valiutos sandoriai dėl kainų skirtumo	Įvykdyti sandoriai, susiję su valiutos sandoriais dėl kainų skirtumo, kurių rinka laikoma likvidžia pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą.	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Biržos prekių sandoriai dėl kainų skirtumo	Įvykdyti sandoriai, susiję su biržos prekių sandoriais dėl kainų skirtumo, kurių rinka laikoma likvidžia pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą.	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Nuosavybės vertybinių popierių sandoriai dėl kainų skirtumo	Įvykdyti sandoriai, susiję su nuosavybės vertybinių popierių sandoriais dėl kainų skirtumo, kurių rinka laikoma likvidžia pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą.	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Obligacijų sandoriai dėl kainų skirtumo	Įvykdyti sandoriai, susiję su nuosavybės vertybinių popierių sandoriais dėl kainų skirtumo, kurių rinka laikoma likvidžia pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR

▼M4

Turto klasė – finansiniai sandoriai dėl kainų skirtumo									
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka yra likvidi**								
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Sandoriai dėl kainų skirtumo, susiję su nuosavybės vertybinių popierių ateities / išankstiniais sandoriais	Įvykdyti sandoriai dėl kainų skirtumo, susiję su ateities sandoriais dėl nuosavybės vertybinio popieriaus, kurio rinka laikoma likvidžia pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą.	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Sandoriai dėl kainų skirtumo, susiję su nuosavybės vertybinių popierių pasirinkimo sandoriais	Įvykdyti sandoriai dėl kainų skirtumo, susiję su pasirinkimo sandoriais dėl nuosavybės vertybinio popieriaus, kurio rinka laikoma likvidžia pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą.	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR

11.3 lentelė

Finansiniai sandoriai dėl kainų skirtumo. Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos poklasiams, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – finansiniai sandoriai dėl kainų skirtumo			
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka nėra likvidi**		
	Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Valiutos sandoriai dėl kainų skirtumo	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Biržos prekių sandoriai dėl kainų skirtumo	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

▼M4

Turto klasė – finansiniai sandoriai dėl kainų skirtumo			
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka nėra likvidi**		
	Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Nuosavybės vertybinių popierių sandoriai dėl kainų skirtumo	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Obligacijų sandoriai dėl kainų skirtumo	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Sandoriai dėl kainų skirtumo, susiję su nuosavybės vertybinių popierių ateities / išankstiniais sandoriais	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Sandoriai dėl kainų skirtumo, susiję su nuosavybės vertybinių popierių pasirinkimo sandoriais	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Kiti sandoriai dėl kainų skirtumo / kainų skirtumų lažybos	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

12. **Apyvartiniai taršos leidimai**

12.1 lentelė

Apyvartiniai taršos leidimai. Klasės, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – apyvartiniai taršos leidimai	
Siekiant nustatyti poklasius, kurių rinka nėra likvidi pagal 6a straipsnį, taikomi šie metodai:	
Turto poklasis	**Likvidumo nustatymas**
Europos Sąjungos apyvartinis taršos leidimas (EUA) – bet koks vienetas, pripažintas atitinkančiu Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2003/87/EB ([1]) (dėl apyvartinių taršos leidimų prekybos sistemos) reikalavimus ir suteikiantis teisę išmesti vienos anglies dioksido tonos ekvivalentą (tCO_2e). RTS2#3 = EMAL ir RTS23#37 = EUAE	Laikoma, kad Europos Sąjungos apyvartinių taršos leidimų rinka yra likvidi.
Kiti apyvartiniai taršos leidimai RTS2#3 = EMAL ir RTS23#37 <> EUAE	Laikoma, kad kitų apyvartinių taršos leidimų rinka nėra likvidi.

([1]) 2003 m. spalio 13 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2003/87/EB, nustatanti šiltnamio efektą sukeliančių dujų emisijos leidimų sistemą Bendrijoje ir iš dalies keičianti Tarybos direktyvą 96/61/EB, (OL L 275, 2003 10 25, p. 32, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2003/87/oj).

▼M4

12.2 lentelė

Apyvartiniai taršos leidimai – didelės apimties riba iki sandorio sudarymo ir dydžio riba po sandorio sudarymo

Turto klasė – apyvartiniai taršos leidimai		
Turto poklasis	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Dydžio riba po sandorio sudarymo**
Europos Sąjungos apyvartiniai taršos leidimai (EUA)	5 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	25 000 tonų anglies dioksido ekvivalento
Kiti apyvartiniai taršos leidimai	Visi dydžiai	Visi dydžiai

▼B

13. **Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės**

▼M3

13.1 lentelė

Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės – klasės, kurių rinka nėra likvidi

	Turto klasė – apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės	
Turto poklasis	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų**	
	Dienos sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra Europos Sąjungos apyvartinių taršos leidimų (EUA) tipo Finansinė priemonė, susijusi su Europos Sąjungos apyvartinių taršos leidimų (EUA) tipo apyvartiniais taršos leidimais, kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES I priedo C skirsnio 4 punkte. RTS2#3 = DERV ir RTS2#4 = EMAL ir RTS2#43 = EUAE	150 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	5

▼M3

Turto poklasis	Turto klasė – apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės	
	Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų	
	Dienos sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra Europos Sąjungos aviacijos apyvartinių taršos leidimų (EUAA) tipo Finansinė priemonė, susijusi su Europos Sąjungos aviacijos apyvartinių taršos leidimų (EUAA) tipo apyvartiniais taršos leidimais, kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES I priedo C skirsnio 4 punkte. RTS2#3 = DERV ir RTS2#4 = EMAL ir RTS2#43 = EUAA	150 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	5
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra patvirtintų išmetamųjų teršalų mažinimo vienetų (CER) tipo Finansinės priemonės, susijusios su patvirtintų išmetamųjų teršalų mažinimo vienetų (CER) tipo apyvartiniais taršos leidimais, kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES I priedo C skirsnio 4 punkte. RTS2#3 = DERV ir RTS2#4 = EMAL ir RTS2#43 = CERE	150 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	5
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra išmetamųjų teršalų mažinimo vienetų (ERU) tipo Finansinės priemonės, susijusios su išmetamųjų teršalų mažinimo vienetų (ERU) tipo apyvartiniais taršos leidimais, kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES I priedo C skirsnio 4 punkte. RTS2#3 = DERV ir RTS2#4 = EMAL ir RTS2#43 = ERUE	150 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	5
Kitos apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra apyvartiniai taršos leidimai, pripažinti atitinkančiais Direktyvos 2003/87/EB (dėl apyvartinių taršos leidimų prekybos sistemos) reikalavimus ir nėra Europos Sąjungos apyvartiniai taršos leidimai (EUA), Europos Sąjungos aviacijos apyvartiniai taršos leidimai (EUAA), patvirtinti išmetamųjų teršalų mažinimo vienetai (CER) ar išmetamųjų teršalų mažinimo vienetai (ERU). RTS2#3 = DERV ir RTS2#4 = EMAL ir RTS2#43 = OTHR	Laikoma, kad kitų apyvartinių taršos leidimų išvestinių finansinių priemonių rinka nėra likvidi.	

▼M4

13.2 lentelė

Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės. Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos poklasiams, kurių rinka yra likvidi

Turto klasė – apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės							
Turto poklasis	**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo turto poklasiams, kurių rinka yra likvidi**					
		Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**		**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**	
		Sandorio procentilis	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra Europos Sąjungos apyvartinių taršos leidimų (EUA) tipo	Įvykdyti sandoriai su visomis apyvartinių taršos leidimų išvestinėmis finansinėmis priemonėmis, kurių pagrindinė priemonė yra Europos Sąjungos apyvartinių taršos leidimų (EUA) tipo.	70	50 000 tonų anglies dioksido	80	90 000 tonų anglies dioksido	90	100 000 tonų anglies dioksido
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra Europos Sąjungos aviacijos apyvartinių taršos leidimų (EUAA) tipo	Įvykdyti sandoriai su visomis apyvartinių taršos leidimų išvestinėmis finansinėmis priemonėmis, kurių pagrindinė priemonė yra Europos Sąjungos aviacijos apyvartinių leidimų (EUAA) tipo.	70	25 000 tonų anglies dioksido	80	40 000 tonų anglies dioksido	90	50 000 tonų anglies dioksido
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra patvirtintų išmetamųjų teršalų mažinimo vienetų (CER) tipo	Įvykdyti sandoriai su visomis apyvartinių taršos leidimų išvestinėmis finansinėmis priemonėmis, kurių pagrindinė priemonė yra patvirtintų išmetamųjų teršalų mažinimo vienetų (CER) tipo.	70	25 000 tonų anglies dioksido	80	40 000 tonų anglies dioksido	90	50 000 tonų anglies dioksido

▼M4

Turto klasė – apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės							
Turto poklasis	**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo turto poklasiams, kurių rinka yra likvidi**					
		Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**		**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**	
		Sandorio procentilis	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra išmetamųjų teršalų mažinimo vienetų (ERU) tipo	Įvykdyti sandoriai su visomis apyvartinių taršos leidimų išvestinėmis finansinėmis priemonėmis, kurių pagrindinė priemonė yra išmetamųjų teršalų mažinimo vienetų (ERU) tipo.	70	25 000 tonų anglies dioksido	80	40 000 tonų anglies dioksido	90	50 000 tonų anglies dioksido

13.3 lentelė

Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės. Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos poklasiams, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo turto poklasiams, kurių rinka nėra likvidi**		
	Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra Europos Sąjungos apyvartinių taršos leidimų (EUA) tipo	50 000 tonų anglies dioksido	90 000 tonų anglies dioksido	100 000 tonų anglies dioksido
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra Europos Sąjungos aviacijos apyvartinių taršos leidimų (EUAA) tipo	25 000 tonų anglies dioksido	40 000 tonų anglies dioksido	50 000 tonų anglies dioksido

▼M4

Turto klasė – apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo turto poklasiams, kurių rinka nėra likvidi**		
	Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra patvirtintų išmetamųjų teršalų mažinimo vienetų (CER) tipo	25 000 tonų anglies dioksido	40 000 tonų anglies dioksido	50 000 tonų anglies dioksido
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra išmetamųjų teršalų mažinimo vienetų (ERU) tipo	25 000 tonų anglies dioksido	40 000 tonų anglies dioksido	50 000 tonų anglies dioksido
Kitos apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės	25 000 tonų anglies dioksido	40 000 tonų anglies dioksido	50 000 tonų anglies dioksido

▼B

IV PRIEDAS

Baziniai duomenys, pateiktini su skaidrumu susijusiems skaičiavimams atlikti

▼M3
▼C1

1 lentelė

2 lentelės simbolių lentelė

SIMBOLIS	DUOMENŲ RŪŠIS	APIBRĖŽTIS
{ALPHANUM-n}	Iki n raidinių skaitinių ženklų	Laukelyje pateikiamas laisvo pobūdžio tekstas.
{DECIMAL-n/m}	Dešimtainis skaičius iki n skaitmenų, iš kurių iki m skaitmenų gali rodyti dalis	Skaitiniame laukelyje įrašomos ir teigiamos, ir neigiamos vertės: 1. dešimtainės trupmenos skiriamos „.“ (tašku); 2. skaičius gali būti su „–“ (minusu), kai yra neigiamas. Atitinkamais atvejais vertės apvalinamos, o ne trumpinamos.
{COUNTRYCODE_2}	2 raidiniai skaitiniai ženklai	Dviraidis ISO 3166–1 šalies kodas.
{CURRENCYCODE_3}	3 raidiniai skaitiniai ženklai	Triraidis ISO 4217 valiutos kodas.
{DATEFORMAT}	ISO 8601 datos formatas	Datos pateikiamos šiuo formatu: MMMM-MM-DD.
{ISIN}	12 raidinių skaitinių ženklų	ISIN kodas pagal ISO 6166.
{LEI}	20 raidinių skaitinių ženklų	Juridinio asmens identifikatorius pagal ISO 17442.
{MIC}	4 raidiniai skaitiniai ženklai	Rinkos identifikatorius pagal ISO 10383.
{EIC}	16 raidinių skaitinių ženklų	EIC kodas – Europos Sąjungoje arba už jos ribų esančios pateikimo vietos kodas.
{INDEX}	4 raidiniai ženklai	EONA – EONIA EONS – EONIA apsikeitimo sandoris EURI – EURIBOR EUUS – euro ir dolerio keitimo kursas EUCH – euro ir Šveicarijos franko keitimo kursas GCFR – GCF REPO (atpirkimo sandoris) ISDA – ISDAFIX LIBI – LIBID LIBO – LIBOR MAAA – „Muni AAA“ PFAN – hipotekos obligacijos (vok. *Pfandbriefe*) TIBO – TIBOR STBO – STIBOR BBSW – BBSW JIBA – JIBAR BUBO – BUBOR CDOR – CDOR

▼C1

SIMBOLIS	DUOMENŲ RŪŠIS	APIBRĖŽTIS
		CIBO – CIBOR MOSP – MOSPRIM NIBO – NIBOR PRBO – PRIBOR TLBO – TELBOR WIBO – WIBOR TREA – iždas SWAP – apsikeitimo sandoris FUSW – ateities apsikeitimo sandoris (angl. *future swap*)

▼M3

2 lentelė

Informacija apie bazinius duomenis, pateiktinus su skaidrumu susijusiems skaičiavimams atlikti

#	LAUKELIS	PATEIKTINA IŠSAMI INFORMACIJA	ATASKAITŲ TEIKIMO FORMA
1.	Priemonės identifikavimo kodas	Finansinei priemonei identifikuoti naudojamas kodas.	{ISIN}
2.	Nesutrumpintas priemonės pavadinimas	Nesutrumpintas finansinės priemonės pavadinimas.	{ALPHANUM-350}
3.	FPRR identifikatorius	**Ne nuosavo kapitalo finansinių priemonių identifikavimas:** **Vertybiniais popieriais pakeistos išvestinės finansinės priemonės**, kaip apibrėžta III priedo 4 skirsnio 4.1 lentelėje **Struktūrizuoti finansiniai produktai** (SFP), kaip apibrėžta Reglamento (ES) Nr. 600/2014 2 straipsnio 1 dalies 28 punkte **Obligacijos (visoms obligacijoms, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas)**, kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES 4 straipsnio 1 dalies 44 punkto b papunktyje **Biržinės prekės**, kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES 4 straipsnio 1 dalies 44 punkto b papunktyje ir patikslinta III priedo 2 skirsnio 2.4 lentelėje **Biržiniai vekseliai**, kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES 4 straipsnio 1 dalies 44 punkto b papunktyje ir patikslinta III priedo 2 skirsnio 2.4 lentelėje **Apyvartiniai taršos leidimai**, kaip apibrėžta III priedo 12 skirsnio 12.1 lentelėje **Išvestinės finansinės priemonės**, kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES I priedo C skirsnio 4–10 punktuose	**Ne nuosavo kapitalo finansinės priemonės:** SDRV – vertybiniais popieriais pakeistos išvestinės finansinės priemonės SFPS – struktūrizuoti finansiniai produktai (SFP) BOND – obligacijos ETCS – biržinės prekės ETNS – biržiniai vekseliai EMAL – apyvartiniai taršos leidimai DERV – išvestinės finansinės priemonės

▼M3

#	LAUKELIS	PATEIKTINA IŠSAMI INFORMACIJA	ATASKAITŲ TEIKIMO FORMA
4.	Pagrindinės priemonės turto klasė	Pildytina, kai FPRR identifikavimo kodas žymi vertybiniais popieriais pakeistą išvestinę finansinę priemonę arba išvestinę finansinę priemonę.	INTR – palūkanų norma EQUI – nuosavybės vertybinis popierius COMM – biržos prekė CRDT – kreditas CURR – valiuta EMAL – apyvartiniai taršos leidimai OCTN – kita C10
5.	Sutarties rūšis	Pildytina, kai FPRR identifikavimo kodas žymi išvestinę finansinę priemonę.	OPTN – pasirinkimo sandoriai FUTUR – ateities sandoriai (įskaitant išankstinius frachto susitarimus (FFA) FRAS – išankstiniai palūkanų normų sandoriai FORW – išankstiniai sandoriai SWAP – apsikeitimo sandoriai PSWP – portfelio apsikeitimo sandoriai SWPT – pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo sandorių OPTS – pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo sandorio FONS – ateities sandoriai dėl apsikeitimo sandorio FWOS – išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo sandorio SPDB – kainų skirtumų lažybų sandoriai CFDS – sandoriai dėl kainų skirtumo OTHR – kita
6.	Informacijos teikimo diena	Diena, kurios baziniai duomenys pateikiami.	{DATEFORMAT}
7.	Prekybos vieta	Prekybos vietos segmento MIC kodas, kai yra, kitais atvejais – veiklos MIC kodas.	{MIC}
8.	Terminas	Nustatytas finansinės priemonės terminas Laukelis, skirtas obligacijų, palūkanų normų išvestinių finansinių priemonių, su nuosavybės vertybiniais popieriais susietų išvestinių finansinių priemonių, biržos prekių išvestinių finansinių priemonių, užsienio valiutos keitimo išvestinių finansinių priemonių, kredito išvestinių finansinių priemonių, C10 išvestinių finansinių priemonių ir apyvartinių taršos leidimų išvestinių finansinių priemonių turto poklasiams.	{DATEFORMAT}

Laukeliai, susiję su obligacijomis (visų rūšių, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas)

Į šio skirsnio laukelius įrašomi tik obligacijų, kaip apibrėžta III priedo 2 skirsnio 2.1 lentelėje, duomenys.

9.	Obligacijų rūšis	Obligacijų rūšis, kaip apibrėžta III priedo 2 skirsnio 2.2 lentelėje. Pildytina, kai FPRR identifikavimo kodu žymimos obligacijos.	EUSB – valstybės obligacijos OEPB – kitos viešosios obligacijos CVTB – konvertuojamosios obligacijos CVDB – padengtosios obligacijos CRPB – įmonių obligacijos OTHR – kita

▼M3

10.	Emisijos data	Data, kurią obligacija išleidžiama ir pradedamos skaičiuoti palūkanos.	{DATEFORMAT}

Su apyvartiniais taršos leidimais susiję laukeliai

Į šio skirsnio laukelius įrašomi tik apyvartinių taršos leidimų, kaip apibrėžta III priedo 12 skirsnio 12.1 lentelėje, duomenys.

11.	Apyvartinių taršos leidimų porūšis	Apyvartiniai taršos leidimai	CERE – CER ERUE – ERU EUAE – EUA EUAA – EUAA OTHR – kita

Su išvestinėmis finansinėmis priemonėmis susiję laukeliai

Biržos prekių išvestinės finansinės priemonės ir C10 išvestinės finansinės priemonės

Į šio skirsnio laukelius įrašomi tik biržos prekių išvestinių finansinių priemonių, kaip apibrėžta III priedo 7 skirsnio 7.1 lentelėje, ir C10 išvestinių finansinių priemonių, kaip apibrėžta III priedo 10 skirsnio 10.1 lentelėje, duomenys.

12.	Dydžio nurodymas pagal frachto porūšį	Pildytina, jei Deleguotojo reglamento (ES) 2017/585 priedo 2 lentelės 35 laukelyje nurodyta bazinė prekė yra frachtas.	Biriųjų krovinių atveju: CAPE – „Capesize“ dydžio PNMX – „Panamax“ dydžio SPMX – „Supramax“ dydžio HAND – „Handysize“ dydžio Skystųjų krovinių atveju: CLAN – „Clean“ DRTY – „Dirty“ {ALPHANUM-4} – kitais atvejais
13.	Konkretus maršrutas arba laivo frachtavimo tam tikram laikui vidurkis	Pildytina, jei Deleguotojo reglamento (ES) 2017/585 priedo 2 lentelės 35 laukelyje nurodyta bazinė prekė yra frachtas.	Skystųjų krovinių atveju: 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

			Biriųjų krovinių atveju: 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} – kitais atvejais
14.	Pateikimo / atsiskaitymo grynaisiais vieta	Pildytina, jei Deleguotojo reglamento (ES) 2017/585 2 lentelės 35 laukelyje nurodyta bazinė prekė yra energija.	{EIC} elektros arba gamtinių dujų atveju OTHR – kita
15.	Tariamosios sumos valiuta	Valiuta, kuria denominuota tariamoji suma	{CURRENCYCODE_3}

Palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės

Į šio skirsnio laukelius įrašomi tik palūkanų normų išvestinių finansinių priemonių, kaip apibrėžta III priedo 5 skirsnio 5.1 lentelėje, duomenys.

16.	Pagrindinės priemonės rūšis	Įrašoma informacija apie tokių rūšių sandorius, kurie nėra apsikeitimo sandoriai, pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo sandorių, ateities sandoriai dėl apsikeitimo sandorių ir išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo sandorių, taikant vieną iš toliau nurodytų alternatyvų. ********** Įrašoma informacija apie šių rūšių sandorius: apsikeitimo sandorius, pasirinkimo sandorius dėl apsikeitimo sandorių, ateities sandorius dėl apsikeitimo sandorių ir išankstinius sandorius dėl apsikeitimo sandorių pagrindinio apsikeitimo sandorio atžvilgiu, taikant vieną iš toliau nurodytų alternatyvų.	BOND – obligacija BNDF – obligacijų ateities sandoriai INTR – palūkanų norma IFUT – palūkanų normų ateities sandoriai ********** FFMC – APSIKEITIMO KELIOMIS VALIUTOMIS KINTAMOMIS PALŪKANOMIS SANDORIAI XFMC – APSIKEITIMO KELIOMIS VALIUTOMIS FIKSUOTOMIS/KINTAMOMIS PALŪKANOMIS SANDORIAI XXMC – APSIKEITIMO KELIOMIS VALIUTOMIS FIKSUOTOMIS PALŪKANOMIS SANDORIAI OSMC – APSIKEITIMO PALŪKANŲ NORMOMIS PAGAL VIENOS NAKTIES INDEKSĄ KELIOMIS VALIUTOMIS SANDORIAI IFMC – APSIKEITIMO INFLIACIJOS RIZIKA KELIOMIS VALIUTOMIS SANDORIAI FFSC – APSIKEITIMO VIENA VALIUTA KINTAMOMIS PALŪKANOMIS SANDORIAI XFSC– APSIKEITIMO VIETA VALIUTA SANDORIAI, KAI VIENAI ŠALIAI NUSTATOMOS FIKSUOTOS, O KITAI – KINTAMOS PALŪKANOS

▼M3

			XXSC – APSIKEITIMO VIENA VALIUTA FIKSUOTOMIS PALŪKANOMIS SANDORIAI OSSC – APSIKEITIMO PALŪKANŲ NORMOMIS PAGAL VIENOS NAKTIES INDEKSĄ VIENA VALIUTA SANDORIAI IFSC – APSIKEITIMO INFLIACIJOS RIZIKA VIENA VALIUTA SANDORIAI
17.	Pagrindinės obligacijos emitentas	Pildytina, kai pagrindinė priemonė yra obligacija arba obligacijų ateities sandoris, nurodant tiesioginės ar galutinės pagrindinės obligacijos emitento juridinio asmens identifikatorių (LEI).	{LEI}
18.	Pagrindinės obligacijos termino data	Pildytina nurodant pagrindinės obligacijos nustatytą termino datą.	{DATEFORMAT}
19.	Pagrindinės obligacijos emisijos data	Pildytina nurodant pagrindinės obligacijos emisijos datą.	{DATEFORMAT}
20.	Pasirinkimo sandorio dėl apsikeitimo sandorio tariamoji valiuta	Pildytina tik pasirinkimo sandorių dėl apsikeitimo sandorių atveju.	{CURRENCYCODE_3}
21.	Pagrindinio apsikeitimo sandorio terminas	Pildytinas tik pasirinkimo sandorių dėl apsikeitimo sandorių, ateities sandorių dėl apsikeitimo sandorių ir išankstinių sandorių dėl apsikeitimo sandorių atvejais.	{DATEFORMAT}
22.	Infliacijos indekso ISIN kodas / Pagrindinės obligacijos ISIN kodas	Pasirinkimo sandorių dėl apsikeitimo sandorių atveju, kai pagrindinis apsikeitimo sandoris yra apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandoris, ateities / išankstinis sandoris dėl apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandorių, apsikeitimo infliacijos rizika keliomis valiutomis sandoris arba ateities / išankstinis sandoris dėl apsikeitimo infliacijos rizika keliomis valiutomis sandorių, laukelyje nurodomas to indekso ISIN kodas, jei yra. ********** Obligacijų pasirinkimo sandorių / Pasirinkimo sandorių dėl obligacijų pasirinkimo sandorio / Pasirinkimo sandorių dėl obligacijų ateities sandorio atveju į šį laukelį įrašomas galutinės pagrindinės obligacijos ISIN kodas.	{ISIN} ********** {ISIN}

▼M3

23.	Infliacijos indekso pavadinimas	Pildytina nurodant standartizuotą indekso pavadinimą, kai pasirinkimo sandorių dėl apsikeitimo sandorių pagrindinis apsikeitimo sandoris yra apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandoris, ateities / išankstinis sandoris dėl apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandorių, apsikeitimo infliacijos rizika keliomis valiutomis sandoris arba ateities / išankstinis sandoris dėl apsikeitimo infliacijos rizika keliomis valiutomis sandorių.	{ALPHANUM-25}
24.	Orientacinė palūkanų norma	Orientacinės palūkanų normos pavadinimas.	{INDEX} arba {ALPHANUM-25} – jeigu orientacinė palūkanų norma neįtraukta į {INDEX} sąrašą.
25.	Pagrindinės palūkanų normos terminas	Šiame laukelyje nurodomas palūkanų normos, kuria grindžiama sutartis, terminas. Terminas nurodomas dienomis, savaitėmis, mėnesiais ar metais. Jei palūkanų normos terminas yra sveikasis skaičius, pradedant nuo didžiausio termino vieneto (metų) ir einant prie mažesnių, šiame lauke įrašomas toks standartinis terminas.	{INTEGER-3}+DAYS – dienos {INTEGER-3}+WEEK – savaitės {INTEGER-3}+MNTH – mėnesiai {INTEGER-3}+YEAR – metai

Užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės

Į šio skirsnio laukelius įrašomi tik užsienio valiutos išvestinių finansinių priemonių, kaip apibrėžta III priedo 8 skirsnio 8.1 lentelėje, duomenys.

26.	Sutarties porūšis	Pildytina siekiant atskirti išankstinius sandorius, pasirinkimo sandorius ir apsikeitimo sandorius su apsikeitimu pagrindine suma ir be apsikeitimo pagrindine suma, kaip apibrėžta III priedo 8 skirsnio 8.1 lentelėje.	DLVB – pagrindinė suma perduodama NDLV – pagrindinė suma neperduodama

Su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės

Į šio skirsnio laukelius įrašomi tik su nuosavybės vertybiniais popieriais susietų išvestinių finansinių priemonių, kaip apibrėžta III priedo 6 skirsnio 6.1 lentelėje, duomenys.

27.	Pagrindinės priemonės rūšis	Pildytina, kai FPRR identifikavimo kodas – išvestinė finansinė priemonė, pagrindinės priemonės turto klasė – nuosavas kapitalas, o turto poklasis nėra nei apsikeitimo sandoris, nei portfelio apsikeitimo sandoris.	STIX – akcijų indeksas SHRS – akcija DIVI – dividendų indeksas DVSE – akcijų dividendai BSKT – emitento įvykių nulemtas akcijų krepšelis ETFS – biržiniai fondai VOLI – kintamumo indeksas OTHR – kita (įskaitant depozitoriumo pakvitavimus, sertifikatus ir kitas į nuosavybės finansines priemones panašias priemones)

▼M3

		********** Pildytina, kai FPRR identifikavimo kodas – išvestinė finansinė priemonė, pagrindinės priemonės turto klasė – nuosavas kapitalas, turto poklasis – apsikeitimo sandoriai arba portfelio apsikeitimo sandoriai, o III priedo 6 skirsnio 6.1 lentelėje apibrėžtas 2 segmentavimo kriterijus yra vienas pavadinimas.	********** SHRS – akcija DVSE – akcijų dividendai ETFS – biržiniai fondai OTHR – kita (įskaitant depozitoriumo pakvitavimus, sertifikatus ir kitas į nuosavybės finansines priemones panašias priemones)
		********** Pildytina, kai FPRR identifikavimo kodas – išvestinė finansinė priemonė, pagrindinės priemonės turto klasė – nuosavas kapitalas, turto poklasis – apsikeitimo sandoriai arba portfelio apsikeitimo sandoriai, o III priedo 6 skirsnio 6.1 lentelėje apibrėžtas 2 segmentavimo kriterijus yra indeksas.	********** STIX – akcijų indeksas DIVI – dividendų indeksas VOLI – kintamumo indeksa OTHR – kita
		********** Pildytina, kai FPRR identifikavimo kodas – išvestinė finansinė priemonė, pagrindinės priemonės turto klasė – nuosavas kapitalas, turto poklasis – apsikeitimo sandoriai arba portfelio apsikeitimo sandoriai, o III priedo 6 skirsnio 6.1 lentelėje apibrėžtas 2 segmentavimo kriterijus yra krepšelis.	********** BSKT – krepšelis
28.	Parametras	Pildytina, kai FPRR identifikavimo kodu žymima išvestinė finansinė priemonė, pagrindinės priemonės turto klasė yra nuosavybė, o turto poklasis yra arba apsikeitimo sandoris, arba portfelio apsikeitimo sandoris.	PRBP – kainos grąžos pagrindinis rezultatų parametras PRDV – grąžos dividendų parametras PRVA – grąžos dispersijos parametras PRVO – grąžos kintamumo parametras

Sandoriai dėl kainų skirtumo

Laukeliai pildomi tik tuo atveju, jei sutarties rūšis yra sandoris dėl kainų skirtumų ar kainų skirtumų lažybų sandoris.

29.	Pagrindinės priemonės rūšis	Pildytina, jei FPRR identifikavimo kodu žymima išvestinė finansinė priemonė, o sutarties rūšis yra sandoris dėl kainų skirtumų ar kainų skirtumų lažybų sandoris.	CURR – valiuta EQUI – nuosavybės vertybinis popierius BOND – obligacijos FTEQ – ateities / išankstiniai sandoriai dėl nuosavybės vertybinių popierių OPEQ – pasirinkimo sandoriai dėl nuosavybės vertybinių popierių COMM – biržos prekės EMAL – apyvartiniai taršos leidimai OTHR – kita

▼M3

30.	1 tariamosios sumos valiuta	Pagrindinės valiutų poros 1-oji valiuta. Laukelis taikytinas, kai pagrindinės priemonės rūšis yra valiuta.	{CURRENCYCODE_3}
31.	2 tariamosios sumos valiuta	Pagrindinės valiutų poros 2-oji valiuta. Laukelis taikytinas, kai pagrindinės priemonės rūšis yra valiuta.	{CURRENCYCODE_3}

Kredito išvestinės finansinės priemonės

Į šio skirsnio laukelius įrašomi tik kredito išvestinių finansinių priemonių, kaip apibrėžta III priedo 9 skirsnio 9.1 lentelėje, duomenys.

32.	Pagrindinio kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorio ISIN kodas	Pildytina kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių išvestinių finansinių priemonių atveju, nurodant pagrindinio apsikeitimo sandorio ISIN kodą.	{ISIN}
33.	Pagrindinio indekso kodas	Pildytina išvestinių finansinių priemonių, susijusių su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, atveju, nurodant indekso ISIN kodą.	{ISIN}
34.	Pagrindinio indekso pavadinimas	Pildytina išvestinių finansinių priemonių, susijusių su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, atveju, nurodant standartizuotą indekso pavadinimą.	{ALPHANUM-25}
35.	Serija	Indekso sudėties serijos numeris, jei yra. Pildytina kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indekso arba išvestinių finansinių priemonių, susijusių su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, atveju, nurodant to indekso seriją.	{DECIMAL-18/17}
36.	Versija	Nauja serijos versija išleidžiama, jei viena iš sudedamųjų dalių neatitinka reikalavimų ir indeksą reikia iš naujo įvertinti, kad būtų atsižvelgta į naują bendrą sudedamųjų indekso dalių skaičių. Pildytina kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indekso arba išvestinių finansinių priemonių, susijusių su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, atveju nurodant to indekso versiją.	{DECIMAL-18/17}
37.	Atnaujinimo mėnesiai	Visi mėnesiai, kuriais numatomas atnaujinimas, kaip nustatyta indekso sudarytojo konkretiems metams. Laukelis kartojamas kiekvienam atnaujinimo mėnesiui. Pildytina kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indekso arba išvestinių finansinių priemonių, susijusių su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, atveju.	01, 02, 03, 04, 05, 06, 07, 08, 09, 10, 11, 12
38.	Kito atnaujinimo data	Pildytina kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indekso arba išvestinių finansinių priemonių, susijusių su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, atveju, nurodant kitą indekso atnaujinimo datą, kurią nustato indekso sudarytojas.	{DATEFORMAT}
39.	Valstybinio ir viešojo tipo emitentas	Pildytina, jei vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorio arba išvestinės finansinės priemonės, susijusios su vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriu, referencinis subjektas yra valstybės skolos vertybinių popierių emitentas, kaip apibrėžta III priedo 9 skirsnio 9.1 lentelėje.	TRUE – referencinis subjektas yra valstybinio ir viešojo tipo emitentas FALSE – referencinis subjektas nėra valstybinio ir viešojo tipo emitentas

▼M3

40.	Pagrindinė pozicija	Pildytina vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių išvestinių finansinių priemonių atveju, nurodant pagrindinės pozicijos ISIN kodą.	{ISIN}
41.	Referencinis subjektas	Pildytina įrašant vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorio arba išvestinės finansinės priemonės, susijusios su vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriu, referencinį subjektą.	{COUNTRYCODE_2} arba ISO 3166–2 – dviraidis valstybės kodas, po jo – brūkšnelis „-“ ir ne daugiau nei 3 raidinių skaitinių simbolių smulkesnių valstybės vienetų kodas arba {LEI}
42.	Tariamosios sumos valiuta	Valiuta, kuria denominuota tariamoji suma	{CURRENCYCODE_3}

Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės

Į šio skirsnio laukelius įrašomi tik apyvartinių taršos leidimų, kaip apibrėžta III priedo 13 skirsnio 13.1 lentelėje, duomenys.

43.	Apyvartinių taršos leidimų išvestinių finansinių priemonių porūšis	Pildytina, kai kintamasis #3 „FPRR identifikavimo kodas“ yra DERV (išvestinės finansinės priemonės), o kintamasis #4 „pagrindinės priemonės turto klasė“ yra EMAL (apyvartiniai taršos leidimai).	CERE – CER ERUE – ERU EUAE – EUA EUAA – EUAA OTHR – kita

▼M3

V PRIEDAS

Kiekybiniai duomenys, pateiktini su skaidrumu susijusiems skaičiavimams atlikti

1 lentelė

2 lentelės simbolių lentelė

Simbolis	Duomenų rūšis	Apibrėžtis
{ALPHANUM-n}	Iki n raidinių skaitinių ženklų	Laukelyje pateikiamas laisvo pobūdžio tekstas.
{ISIN}	12 raidinių skaitinių ženklų	ISIN kodas pagal ISO 6166.
{MIC}	4 raidiniai skaitiniai ženklai	Rinkos identifikatorius pagal ISO 10383.
{DATEFORMAT}	ISO 8601 datos formatas	Datos pateikiamos šiuo formatu: MMMM-MM-DD.
{DECIMAL-n/m}	Dešimtainis skaičius iš viso iki n skaitmenų, iš kurių iki m skaitmenų gali rodyti dalis	Skaičiaus laukelyje įrašomos ir teigiamos, ir neigiamos vertės. Dešimtainės trupmenos skiriamos „.“ (tašku); neigiami skaičiai nurodomi su „–“ (minusu); vertės apvalinamos, o ne trumpinamos.
{INTEGER-n}	Sveikasis skaičius iš viso iki n skaitmenų	Skaičiaus laukelyje įrašomos ir teigiamos, ir neigiamos sveikojo skaičiaus vertės.

2 lentelė

Išsamūs duomenys, pateiktini siekiant nustatyti likvidžią rinką ir didelės apimties bei priemonei būdingo dydžio ribas ne nuosavo kapitalo finansinėms priemonėms

#	Laukelis	Pateiktina išsami informacija	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Informacijos teikimo formatas ir standartai
1.	Priemonės identifikavimo kodas	Finansinei priemonei identifikuoti naudojamas kodas.	Reguliuojama rinka (RM) Daugiašalė prekybos sistema (MTF) Organizuotos prekybos sistema (OTF) Patvirtintas skelbimo subjektas (APA) Konsoliduotos informacinės juostos teikėjas (CTP)	{ISIN}
2.	Įvykdymo data	Sandorių įvykdymo data.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DATEFORMAT}

▼M3

#	Laukelis	Pateiktina išsami informacija	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Informacijos teikimo formatas ir standartai
3.	Vykdymo vieta	ES prekybos vietos arba sistemingai sandorius savo viduje sudarančio tarpininko segmento MIC kodas, kai yra; kitais atvejais – veiklos MIC kodas. Sistemingai sandorius savo viduje sudarančio tarpininko segmento MIC kodas, kai yra; kitais atvejais – veiklos MIC kodas. Ne biržos sandorių atveju – MIC kodas „XOFF“. Konkretaus ISIN kodo ir įvykdymo datos atveju patvirtinti skelbimo subjektai visą nebiržinės prekybos ta priemone veiklą apibendrina viename įraše (ISIN kodas, „XOFF“, įvykdymo data).	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{MIC} – prekybos vietos arba sistemingai sandorius savo viduje sudarančio tarpininko arba „XOFF“
4.	Priemonės, kurios prekyba sustabdyta, žyma	Nurodoma, ar įvykdymo dieną prekyba priemone atitinkamoje prekybos vietoje buvo sustabdyta visai prekybos dienai. Todėl 5 laukeliuose nurodoma nulinė vertė.	RM, MTF, OTF	TRUE – jei prekyba priemone buvo sustabdyta visai prekybos dienai arba FALSE – jei prekyba priemone nebuvo sustabdyta visai prekybos dienai
5.	Bendras sandorių skaičius	Bendras įvykdymo dieną įvykdytų sandorių skaičius. Atšaukti sandoriai neįtraukiami į pateikiamus duomenis. Sandoriai, kurių duomenų skelbimas buvo atidėtas, įtraukiami į duomenis teikiančių subjektų pateiktas suvestines remiantis įvykdymo dienos duomenimis. Visais atvejais laukelis turi būti užpildytas verte, kuri lygi nuliui arba didesnė. Jei prekyba priemone buvo sustabdyta visai dienai, laukelyje įrašoma nulinė vertė.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
6.	Bendra apimtis	Bendra įvykdymo dieną įvykdytos prekybos apimtis. Apimtis apskaičiuojama vadovaujantis šio reglamento II priedo 4 lentele. Piniginės sumos nurodomos eurais. Atšaukti sandoriai neįtraukiami į pateikiamus duomenis. Sandoriai, kurių duomenų skelbimas buvo atidėtas, įtraukiami į duomenis teikiančių subjektų pateiktas suvestines remiantis įvykdymo dienos duomenimis.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

▼**M3**

#	Laukelis	Pateiktina išsami informacija	Vykdymo arba skelbimo vietos rūšis	Informacijos teikimo formatas ir standartai
7.	Sandorių dydžio intervalas	Šis laukelis užpildomas šio priedo 3 ir 4 lentelėse nurodytomis vertėmis. Sandorių dydžio intervalas, kaip apibrėžta: šio priedo 4 lentelėje apyvartinių taršos leidimų ir jų išvestinių finansinių priemonių atveju; šio priedo 3 lentelėje kitų priemonių atveju. Jei prekyba priemone buvo sustabdyta visai dienai, su šiuo ir 8 bei 9 laukeliais susiję duomenys nepateikiami.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{ALPHANUM - -140}
8.	Bendras tame intervale įvykdytų sandorių skaičius	Bendras sandorių, įvykdytų įvykdymo dieną, kurių dydis patenka į intervalą, skaičius. Atšaukti sandoriai neįtraukiami į pateikiamus duomenis. Sandoriai, kurių duomenų skelbimas buvo atidėtas, įtraukiami į duomenis teikiančių subjektų pateiktas suvestines remiantis įvykdymo dienos duomenimis.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
9.	Bendra prekybos tame intervale apimtis	Bendra prekybos apimtis, atitinkanti visus ataskaitinę dieną įvykdytus sandorius, kurių dydis patenka į intervalą. Apimtis apskaičiuojama vadovaujantis šio reglamento II priedo 4 lentele. Piniginės sumos nurodomos eurais. Atšaukti sandoriai neįtraukiami į pateikiamus duomenis. Sandoriai, kurių duomenų skelbimas buvo atidėtas, įtraukiami į duomenis teikiančių subjektų pateiktas suvestines remiantis įvykdymo dienos duomenimis.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

▼M3

3 lentelė

Obligacijų, struktūrizuotų finansinių produktų, vertybiniais popieriais pakeistų išvestinių finansinių priemonių, palūkanų normų išvestinių finansinių priemonių, su nuosavybės vertybiniais popieriais susietų išvestinių finansinių priemonių, užsienio valiutos keitimo išvestinių finansinių priemonių, kredito išvestinių finansinių priemonių, biržos prekių išvestinių finansinių priemonių, C10 išvestinių finansinių priemonių sandorių ir sandorių dėl kainų skirtumo dydžio intervalas

Taikymo sritis	Sandorių dydžio intervalas	Apibrėžtis
Sandoriai, kurių dydis nuo 0 iki 1,000,000 (neįskaitant)	]0 – 100,000[	Sandoriai, kurių vertė yra mažesnė nei 100,000 EUR
	[100,000 – 100,000]	Sandoriai, kurių vertė yra 100,000 EUR
	]100,000 – 200,000[	Sandoriai, kurių vertė yra didesnė nei 100,000 EUR, bet mažesnė nei 200,000 EUR
	[200,000 – 300,000[	Sandoriai, kurių vertė yra 200,000 EUR arba didesnė, bet mažesnė nei 300,000 EUR
	[300,000 – 400,000[	Sandoriai, kurių vertė yra 300,000 EUR arba didesnė, bet mažesnė nei 400,000 EUR
	[Y– Y+ 100,000[	Sandoriai, kurių vertė yra Y EUR arba didesnė, bet mažesnė nei Y + 100,000 EUR (100,000 EUR pakopa)
	[900,000 – 1,000,000[	Sandoriai, kurių vertė yra 900,000 EUR arba didesnė, bet mažesnė nei 1,000,000 EUR
Sandoriai, kurių dydis nuo 1,000,000 (įskaitant) iki 10,000,000 (neįskaitant)	[1,000,000 – 1,500,000[	Sandoriai, kurių vertė yra 1,000,000 EUR arba didesnė, bet mažesnė nei 1,500,000 EUR
	[1,500,000 – 2,000,000[	Sandoriai, kurių vertė yra 1,500,000 EUR arba didesnė, bet mažesnė nei 2,000,000 EUR
	[Z– Z+ 500,000[	Sandoriai, kurių vertė yra Z EUR arba didesnė, bet mažesnė nei Z + 500,000 EUR (500,000 EUR pakopa)
	[9,500,000 – 10,000,000[	Sandoriai, kurių vertė yra 9,500,000 EUR arba didesnė, bet mažesnė nei 10,000,000 EUR
Sandoriai, kurių dydis nuo 10,000,000 (įskaitant) iki 100,000,000 (neįskaitant)	[10,000,000 – 15,000,000[	Sandoriai, kurių vertė yra 10,000,000 EUR arba didesnė, bet mažesnė nei 15,000,000 EUR
	[15,000,000 – 20,000,000[	Sandoriai, kurių vertė yra 15,000,000 EUR arba didesnė, bet mažesnė nei 20,000,000 EUR
	[W– W+5,000,000[	Sandoriai, kurių vertė yra W EUR arba didesnė, bet mažesnė nei W + 5,000,000 EUR (5,000,000 EUR pakopa)
	[95,000,000 – 100,000,000[	Sandoriai, kurių vertė yra 95,000,000 EUR arba didesnė, bet mažesnė nei 100,000,000 EUR
Sandoriai, kurių dydis yra 100,000,000 arba didesnis	[100,000,000 – 125,000,000[	Sandoriai, kurių vertė yra 100,000,000 EUR arba didesnė, bet mažesnė nei 125,000,000 EUR
	[125,000,000 – 150,000,000[	Sandoriai, kurių vertė yra 125,000,000 EUR arba didesnė, bet mažesnė nei 150,000,000 EUR
	[X– X+25,000,000[	Sandoriai, kurių vertė yra X EUR arba didesnė, bet mažesnė nei X + 25,000,000 EUR (25,000,000 EUR pakopa)
…	…	…

▼M3

4 lentelė

Apyvartinių taršos leidimų ir apyvartinių taršos leidimų išvestinių finansinių priemonių sandorių dydžio intervalas

Taikymo sritis	Sandorių dydžio intervalas	Apibrėžtis
Sandoriai, kurių dydis nuo 0 iki 1,000,000 (neįskaitant)	]0 – 100,000[	Sandoriai, kurių dydis mažesnis nei 100,000 tonų anglies dioksido ekvivalento (t CO_2e)
	[100,000 – 100,000]	Sandoriai, kurių dydis yra 100,000 t CO_2e
	]100,000 – 200,000[	Sandoriai, kurių dydis didesnis nei 100,000 t CO_2e, bet mažesnis nei 200,000 t CO_2e
	[200,000 – 300,000[	Sandoriai, kurių dydis 200,000 t Co_2e arba didesnis, bet mažesnis nei 300,000 t CO_2e
	[300,000 – 400,000[	Sandoriai, kurių dydis 300,000 t Co_2e arba didesnis, bet mažesnis nei 400,000 t CO_2e
	[Y– Y+ 100,000[	Sandoriai, kurių dydis Y t Co_2e arba didesnis, bet mažesnis nei Y t Co_2e + 100,000 (100,000 t Co_2e pakopa)
	[900,000 – 1,000,000[	Sandoriai, kurių dydis 900,000 t Co_2e arba didesnis, bet mažesnis nei 1,000,000 t CO_2e
Sandoriai, kurių dydis nuo 1,000,000 (įskaitant) iki 10,000,000 (neįskaitant)	[1,000,000 – 1,500,000[	Sandoriai, kurių dydis 1,000,000 t Co_2e arba didesnis, bet mažesnis nei 1,500,000 t CO_2e
	[1,500,000 – 2,000,000[	Sandoriai, kurių dydis 1,500,000 t Co_2e arba didesnis, bet mažesnis nei 2,000,000 t CO_2e
	[Z– Z+ 500,000[	Sandoriai, kurių dydis Z t Co_2e arba didesnis, bet mažesnis nei Z t Co_2e + 500,000 (500,000 t Co_2e pakopa)
	[9,500,000 – 10,000,000[	Sandoriai, kurių dydis 9,500,000 t Co_2e arba didesnis, bet mažesnis nei 10,000,000 t CO_2e
Sandoriai, kurių dydis nuo 10,000,000 (įskaitant) iki 100,000,000 (neįskaitant)	[10,000,000 – 15,000,000[	Sandoriai, kurių dydis 10,000,000 t Co_2e arba didesnis, bet mažesnis nei 15,000,000 t CO_2e
	[15,000,000 – 20,000,000[	Sandoriai, kurių dydis 15,000,000 t Co_2e arba didesnis, bet mažesnis nei 20,000,000 t CO_2e
	[W– W+5,000,000[	Sandoriai, kurių dydis W t Co_2e arba didesnis, bet mažesnis nei W t Co_2e + 5,000,000 (5,000,000 t Co_2e pakopa)
	[95,000,000 – 100,000,000[	Sandoriai, kurių dydis 95,000,000 t Co_2e arba didesnis, bet mažesnis nei 100,000,000 t CO_2e
Sandoriai, kurių dydis yra 100,000,000 arba didesnis	[100,000,000 – 125,000,000[	Sandoriai, kurių dydis 100,000,000 t Co_2e arba didesnis, bet mažesnis nei 125,000,000 t CO_2e
	[125,000,000 – 150,000,000[	Sandoriai, kurių dydis 125,000,000 t Co_2e arba didesnis, bet mažesnis nei 150,000,000 t CO_2e
	[X– X+25,000,000[	Sandoriai, kurių dydis X t Co_2e arba didesnis, bet mažesnis nei X t Co_2e + 25,000,000 (25,000,000 t Co_2e pakopa)
…	…	…