Šis dokuments ir tikai informatīvs, un tam nav juridiska spēka. Eiropas Savienības iestādes neatbild par tā saturu. Attiecīgo tiesību aktu un to preambulu autentiskās versijas ir publicētas Eiropas Savienības "Oficiālajā Vēstnesī" un ir pieejamas datubāzē "Eur-Lex". Šie oficiāli spēkā esošie dokumenti ir tieši pieejami, noklikšķinot uz šajā dokumentā iegultajām saitēm

►B

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) 2017/583

(2016. gada 14. jūlijs),

ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 600/2014 par finanšu instrumentu tirgiem papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par pārredzamības prasībām tirdzniecības vietām un ieguldījumu brokeru sabiedrībām attiecībā uz obligācijām, strukturētā finansējuma produktiem, emisijas kvotām un atvasinātajiem instrumentiem

(Dokuments attiecas uz EEZ)

(OV L 87, 31.3.2017., 229. lpp.)

Grozīta ar:

		Oficiālais Vēstnesis		
		Nr.	Lappuse	Datums
►M1	Komisijas Deleģētā regula (ES) 2021/529 (2020. gada 18. decembris)	L 106	47	26.3.2021.
►M2	Komisijas Deleģētā regula (ES) 2022/629 (2022. gada 12. janvāris)	L 115I	1	13.4.2022.
►M3	Komisijas Deleģētā regula (ES) 2023/945 (2023. gada 17. janvāris)	L 131	17	16.5.2023.
►M4	Komisijas Deleģētā regula (ES) 2025/1246 (2025. gada 18. jūnijs)	L 1246	1	3.11.2025.

Labota ar:

►C1	Kļūdu labojums, OV L 90102, 21.11.2023., 1. lpp. (2023/945)

▼B

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) 2017/583

(2016. gada 14. jūlijs),

ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 600/2014 par finanšu instrumentu tirgiem papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par pārredzamības prasībām tirdzniecības vietām un ieguldījumu brokeru sabiedrībām attiecībā uz obligācijām, strukturētā finansējuma produktiem, emisijas kvotām un atvasinātajiem instrumentiem

(Dokuments attiecas uz EEZ)

I NODAĻA

DEFINĪCIJAS

▼M4

1. pants

Definīcijas

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 9. panta 5. punkta f) apakšpunkts)

Šajā regulā piemēro šādas definīcijas:

1) "centralizēta ierobežotu rīkojumu reģistra tirdzniecības sistēma" ir jebkura no šādām sistēmām:

   a) nepārtrauktu rīkojumu reģistra tirdzniecības sistēma, kas nepārtraukti ar rīkojumu reģistra un tirdzniecības algoritma palīdzību automātiski savieto pārdošanas rīkojumus ar pirkšanas rīkojumiem, pamatojoties uz labāko pieejamo cenu;

   b) tirdzniecības sistēma, kurā apvienoti nepārtrauktu rīkojumu reģistra tirdzniecības sistēmas elementi, kā minēts a) apakšpunktā, un periodisko izsoļu tirdzniecības sistēmas elementi, kā definēts 2. punktā;

2) "periodisko izsoļu tirdzniecības sistēma" ir tirdzniecības sistēma, kas rīkojumus savieto, pamatojoties uz periodiskām izsolēm un tirdzniecības algoritmu.

1.a pants

Regulas 3., 6., 8., 9., 10., 11. un 13. panta piemērošanas joma

1. Regulas 3., 6., 9., 10., 11. un 13. pantu piemēro tikai atvasinātajiem instrumentiem. Regulas 8. pantu piemēro tikai atvasināto instrumentu un paketes darījumiem.

2. Atsauces uz Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. pantu, kas ietvertas šīs regulas 8. un 11. pantā, uzskata par atsaucēm uz Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. pantu, kas bija piemērojams pirms 2024. gada 28. marta.

▼B

II NODAĻA

PIRMSTIRDZNIECĪBAS PĀRREDZAMĪBA REGULĒTIEM TIRGIEM, DAUDZPUSĒJĀM TIRDZNIECĪBAS SISTĒMĀM UN ORGANIZĒTĀM TIRDZNIECĪBAS SISTĒMĀM

2. pants

Pirmstirdzniecības pārredzamības pienākumi

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 8. panta 1. un 2. punkts)

Tirgus uzturētāji un ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas uztur tirdzniecības vietu, publisko pirkšanas un pārdošanas piedāvājumu cenas un tirdzniecības interešu dziļumu pie šādām cenām saskaņā ar tirdzniecības sistēmu, ko tie uztur, un I pielikumā izklāstītajām informācijas prasībām.

3. pants

Apjomīgi rīkojumi

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 9. panta 1. punkta a) apakšpunkts)

Rīkojums, kurš ir liels pēc apjoma, salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, ir rīkojums, kura ievietošanas brīdī vai pēc jebkura grozījuma izdarīšanas rīkojumā, ir līdzvērtīgs rīkojuma minimālajam apjomam vai lielāks par to saskaņā ar 13. pantā noteikto metodi.

▼M4

3.a pants

Pēc apjoma lieli rīkojumi attiecībā uz obligācijām, strukturētā finansējuma produktiem un emisijas kvotām

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 9. panta 1. punkta a) apakšpunkts)

Rīkojums attiecībā uz obligācijām, strukturētā finansējuma produktiem vai emisijas kvotām ir liels pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, ja rīkojuma ievadīšanas vietā vai pēc jebkādiem rīkojuma grozījumiem minētais rīkojums ir vienāds ar šādām robežvērtībām vai lielāks par tām:

a) visiem obligāciju veidiem, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes, – robežvērtībām, kas noteiktas III pielikuma 2.3. tabulā;

b) biržā tirgotām precēm un biržā tirgotām parādzīmēm – robežvērtībām, kas noteiktas III pielikuma 2.5. tabulā;

c) strukturētā finansējuma produktiem – robežvērtībām, kas noteiktas III pielikuma 3.2. tabulā;

d) emisijas kvotām – robežvērtībām, kas noteiktas III pielikuma 12.2. tabulā.

▼B

4. pants

Rīkojumu pārvaldības sistēmā turēto rīkojumu veids un minimālais apjoms

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 9. panta 1. punkta a) apakšpunkts)

1. Tirdzniecības vietas rīkojumu pārvaldības sistēmā turēta rīkojuma veids, par kuru vēl nav veikta informācijas atklāšana un attiecībā uz ko var atcelt pirmstirdzniecības pārredzamības pienākumus, ir rīkojums:

a) ko ir plānots atklāt rīkojumu reģistrā, ko uztur attiecīgā tirdzniecības vieta un kas ir atkarīgs no objektīviem apstākļiem, kuri ir iepriekš noteikti sistēmas protokolā;

b) kas nav saistīts ar citām tirdzniecības interesēm pirms atklāšanas tirdzniecības vietas rīkojumu reģistrā;

c) kas, tiklīdz atklāts rīkojumu reģistrā, ir saistīts ar citiem rīkojumiem saskaņā ar attiecīgā veida rīkojumiem informācijas atklāšanas laikā piemērojamajiem noteikumiem.

2. Tirdzniecības vietas rīkojumu pārvaldības sistēmā turēto rīkojumu, par kuriem vēl nav veikta informācijas atklāšana un kuriem var piemērot atbrīvojumu no pirmstirdzniecības pārredzamības pienākumiem, minimālais apjoms reģistrēšanas brīdī un pēc jebkurām izmaiņām ir šāds:

a) rezerves rīkojuma apjoms ir EUR 10 000 vai lielāks;

b) attiecībā uz pārējiem rīkojumiem apjoms ir vienāds ar minimālo tirgojamo daudzumu, ko iepriekš noteicis sistēmas operators saskaņā ar saviem noteikumiem un protokoliem, vai lielāks par to.

3. Šā panta 2. punkta a) apakšpunktā minēto rezerves rīkojumu uzskata par ierobežojošu rīkojumu, ko veido atklāts rīkojums, kas attiecas uz konkrēta daudzuma daļu, un neatklāts rīkojums, kas attiecas uz šāda daudzuma atlikumu, ja ar neatklāto daudzumu var veikt darījumu tikai pēc tam, kad tas ir reģistrēts rīkojumu reģistrā kā jauns rīkojums, par ko atklāta informācija.

▼M3

4. Šā panta 2. punkta a) apakšpunkta nolūkā rīkojumu pārvaldības sistēmā turēto rīkojumu apjomu mēra pēc tirgoto līgumu nosacītās summas, kā minēts II pielikuma 2. tabulas 10. laukā.

▼M4

———————

▼B

6. pants

Finanšu instrumentu klases, kurām nav likvīda tirgus

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 9. panta 1. punkta c) apakšpunkts)

Uzskata, ka finanšu instrumentam vai finanšu instrumentu klasei nav likvīda tirgus, ja tā ir norādīts saskaņā ar 13. pantā noteikto metodi.

▼M4

6.a pants

Obligāciju, strukturētā finansējuma produktu un emisijas kvotu klases, kurām nav likvīda tirgus

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 9. panta 1. punkta c) apakšpunkts)

Lai noteiktu, vai uzskatāms, ka obligācijai, strukturētā finansējuma produktam vai emisijas kvotai nav likvīda tirgus, kompetentās iestādes veic šādu statisku likviditātes noteikšanu:

a) visiem obligāciju veidiem, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes, – kā izklāstīts III pielikuma 2.2. tabulā;

b) biržā tirgotām precēm un biržā tirgotām parādzīmēm – kā izklāstīts III pielikuma 2.4. tabulā;

c) strukturētā finansējuma produktiem – kā izklāstīts III pielikuma 3.1. tabulā;

d) emisijas kvotām – kā izklāstīts III pielikuma 12.1. tabulā.

▼B

III NODAĻA

PĒCTIRDZNIECĪBAS PĀRREDZAMĪBA TIRDZNIECĪBAS VIETĀM UN IEGULDĪJUMU BROKERU SABIEDRĪBĀM, KAS VEIC TIRDZNIECĪBU ĀRPUS TIRDZNIECĪBAS VIETAS

7. pants

Pēctirdzniecības pārredzamības pienākumi

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 10. panta 1. punkts un 21. panta 1. un 5. punkts)

1. Ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas veic tirdzniecību, neievērojot tirdzniecības vietas noteikumus, un tirgus uzturētāji un ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas uztur tirdzniecības vietu, atsaucoties uz katru darījumu, publicē informāciju, kas noteikta II pielikuma 1. un 2 tabulā, un izmanto II pielikuma 3. tabulā uzskaitīto katru piemērojamo karodziņu.

▼M4

Lauku nosaukumus, kas noteikti II pielikuma 2. tabulā, publisko, izmantojot tos pašus nosaukumu veidošanas principus, kā norādīts minētās tabulas lauka identifikatorā.

▼B

2. Ja tiek atcelts iepriekš publicēts ziņojums par tirdzniecību, ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas veic tirdzniecību ārpus tirdzniecības vietas, un tirgus uzturētāji un ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas uztur tirdzniecības vietu, publicē jaunu ziņojumu par tirdzniecību, kas ietver visu sākotnējā tirdzniecības ziņojumā ietverto informāciju un II pielikuma 3. tabulā precizēto atcelšanas karodziņu.

3. Ja tiek veiktas izmaiņas iepriekš publicētā ziņojumā par tirdzniecību, ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas veic tirdzniecību ārpus tirdzniecības vietas, un tirgus uzturētāji un ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas uztur tirdzniecības vietu, publicē šādu informāciju:

a) jauns ziņojums par tirdzniecību, kas ietver visu sākotnējā tirdzniecības ziņojumā ietverto informāciju, un atcelšanas karodziņš, kā precizēts II pielikuma 3. tabulā;

b) jauns ziņojums par tirdzniecību, kas ietver visu sākotnējā tirdzniecības ziņojumā ietverto informāciju ar visu nepieciešamo laboto informāciju, un grozījumu karodziņš, kā precizēts II pielikuma 3. tabulā.

▼M4

4. Pēctirdzniecības informāciju dara pieejamu iespējami tuvāk reāllaikam, cik vien tehniski iespējams, un jebkurā gadījumā piecu minūšu laikā pēc attiecīgā darījuma izpildes.

_____

▼B

7. Ieguldījumu brokeru sabiedrības veic visus saprātīgos pasākumus, lai nodrošinātu, ka darījums tiek darīts publiski pieejams kā viens darījums. Šim mērķim divi sapāroti darījumi, kas iegrāmatoti vienlaikus par to pašu cenu vienam un tam pašam darījuma partnerim, uzskatāmi par vienu darījumu.

▼M4

8. Informācija, kas attiecas uz paketes darījumu, ietver paketes darījuma karodziņu vai karodziņu, kas norāda apmaiņas pret fiziskiem aktīviem darījumu, kā precizēts II pielikuma 3. tabulā. Ja paketes darījums ir atbilstīgs atliktai publicēšanai saskaņā ar 8. pantu, informāciju par visām komponentēm dara pieejamu pēc tam, kad ir beidzies attiecīgā darījuma atlikšanas laikposms.

▼B

8. pants

Darījumu atlikta publicēšana

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 1. un 3. punkts un 21. panta 4. punkts)

1. Ja kompetentā iestāde atļauj veikt darījumu informācijas atliktu publicēšanu saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 1. punktu, ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas veic tirdzniecību ārpus tirdzniecības vietas, un tirgus uzturētāji un ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas uztur tirdzniecības vietu, publicē katru darījumu ne vēlāk kā 19:00 pēc vietējā laika otrajā darbdienā pēc attiecīgā darījuma noslēgšanas dienas, ja ir izpildīts viens no šādiem nosacījumiem:

a) darījums ir liels pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, kā precizēts 9. pantā;

▼B

b) darījums ir veikts ar finanšu instrumentu vai finanšu instrumentu klasi, kurai nav likvīda tirgus, kā ir norādīts saskaņā ar 13. pantā noteikto metodi;

c) darījums ir noslēgts starp ieguldījumu brokeru sabiedrību, kas rīkojas savā vārdā, nevis pēc sapārotas tirdzniecības principa, kā noteikts Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2014/65/ES ([1]) 4. panta 1. punkta 38) apakšpunktā, un citu darījumu partneri un pārsniedz attiecīgajam instrumentam raksturīgo apjomu, kā precizēts 10. pantā;

d) darījums ir paketes darījums, kas atbilst vienam no šādiem kritērijiem:

i) viena vai vairākas no tā komponentēm ir darījumi ar finanšu instrumentiem, kuriem nav likvīda tirgus;

ii) viena vai vairākas no tā komponentēm ir darījumi ar finanšu instrumentiem, kas ir lieli pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, kā noteikts 9. pantā;

iii) darījums ir noslēgts starp ieguldījumu brokeru sabiedrību, kas rīkojas savā vārdā, nevis pēc sapārotas tirdzniecības principa, kā noteikts Direktīvas 2014/65/ES 4. panta 1. punkta 38) apakšpunktā, un citu darījumu partneri, un viena vai vairākas tā komponentes ir darījumi ar finanšu instrumentiem, kas pārsniedz attiecīgajam instrumentam raksturīgo apjomu, kā noteikts 10. pantā.

2. Kad ir beidzies 1. punktā noteiktais atlikšanas laikposms, publicē visu informāciju par darījumu, izņemot, ja saskaņā ar 11. pantu ir piešķirts atlikšanas laikposma pagarinājums uz pagaidu vai nenoteiktu laiku.

3. Ja darījums starp divām ieguldījumu brokeru sabiedrībām savā vārdā vai klientu vārdā ir veikts, neievērojot tirdzniecības vietas noteikumus, attiecīgā kompetentā iestāde nolūkā noteikt piemērojamo atlikšanas režīmu ir tās ieguldījumu brokeru sabiedrības kompetentā iestāde, kas ir atbildīga par darījuma publicēšanu, izmantojot APS, saskaņā ar 7. panta 5., 6. un 7. punktu.

▼M4

8.a pants

Darījumu ar obligācijām, strukturētā finansējuma produktiem un emisijas kvotām atlikta publicēšana

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. pants)

1. Tirgus uzturētāji un ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas uztur tirdzniecības vietu, un ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas veic tirdzniecību ārpus tirdzniecības vietas, var atlikt informācijas publicēšanu par darījumiem ar obligācijām, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes, saskaņā ar šādiem nosacījumiem:

([1]) Eiropas Parlamenta un Padomes 2014. gada 15. maija Direktīva 2014/65/ES par finanšu instrumentu tirgiem un ar ko groza Direktīvu 2002/92/ES un Direktīvu 2011/61/ES (OV L 173, 12.6.2014., 349. lpp.).

▼M4

a) cenas un apjoma publicēšana tiek atlikta ne ilgāk kā uz 15 minūtēm 1. kategorijas darījumiem, kā minēts III pielikuma 2.6. tabulā;

b) cenas un apjoma publicēšana tiek atlikta ne ilgāk kā līdz tirdzniecības dienas beigām 2. kategorijas darījumiem, kā minēts III pielikuma 2.6. tabulā;

c) cenas publicēšana tiek atlikta ne ilgāk kā līdz pirmās tirdzniecības dienas beigām, kas ir pēc darījuma dienas, un apjoma publicēšana tiek atlikta ne ilgāk kā uz vienu nedēļu pēc darījuma dienas 3. kategorijas darījumiem, kā minēts III pielikuma 2.6. tabulā;

d) cenas publicēšana tiek atlikta ne ilgāk kā līdz otrās tirdzniecības dienas beigām, kas ir pēc darījuma dienas, un apjoma publicēšana tiek atlikta ne ilgāk kā uz divām nedēļām pēc darījuma dienas 4. kategorijas darījumiem, kā minēts III pielikuma 2.6. tabulā;

e) cenas un apjoma publicēšana tiek atlikta ne ilgāk kā uz četrām nedēļām pēc darījuma dienas 5. kategorijas darījumiem, kā minēts III pielikuma 2.6. tabulā.

2. Tirgus uzturētāji un ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas uztur tirdzniecības vietu, un ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas veic tirdzniecību ārpus tirdzniecības vietas, var atlikt informācijas publicēšanu par darījumiem attiecībā uz biržā tirgotām precēm, biržā tirgotām parādzīmēm un strukturētiem finanšu produktiem saskaņā ar šādiem nosacījumiem:

a) cenas publicēšana tiek atlikta ne ilgāk kā līdz otrās tirdzniecības dienas, kas seko darījuma dienai, beigām jebkāda apjoma darījumiem, un

b) apjoma publicēšana tiek atlikta ne ilgāk kā uz divām nedēļām pēc darījuma dienas jebkāda apjoma darījumiem.

3. Tirgus uzturētāji un ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas uztur tirdzniecības vietu, un ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas veic tirdzniecību ārpus tirdzniecības vietas, katru darījumu ar emisijas kvotām publisko ne vēlāk kā 19.00 pēc vietējā laika otrajā darbdienā pēc darījuma dienas, ja darījums pārsniedz pēctirdzniecības apjomu attiecībā uz emisijas kvotām, kā minēts III pielikuma 12.2. tabulā.

▼B

9. pants

Darījumi, kas ir lieli pēc apjoma

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 1. punkta a) apakšpunkts)

Darījumu uzskata par lielu pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, ja tas ir līdzvērtīgs darījuma minimālajam apjomam, ko aprēķina saskaņā ar 13. pantā noteikto metodi, vai lielāks par to.

▼B

10. pants

Konkrētam finanšu instrumentam raksturīgs apjoms

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 1. punkta c) apakšpunkts)

Uzskata, ka darījuma apjoms pārsniedz konkrētam finanšu instrumentam raksturīgu apjomu, ja tas ir līdzvērtīgs darījuma minimālajam apjomam, ko aprēķina saskaņā ar 13. pantā noteikto metodi, vai lielāks par to.

11. pants

Pārredzamības prasības saistībā ar atliktu publicēšanu, par ko izlemj kompetentās iestādes

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkts)

1. Ja kompetentās iestādes izmanto savas pilnvaras saistībā ar atliktās publicēšanas atļaušanu saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punktu, piemēro šādus noteikumus:

a) ja piemēro Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkta a) apakšpunktu, kompetentās iestādes pieprasa, lai visu atlikšanas laikposmu, kas minēts 8. pantā, tiek publicēta šāda informācija:

   i) visa informācija par darījumu, kas noteikta II pielikuma 1. un 2. tabulā, izņemot informācija par apjomu;

   ii) vai darījumi dienas apkopotā formātā, kas ietver vismaz 5 darījumus, kas izpildīti tajā pašā dienā, kas jāpublicē nākamajā darbdienā līdz 9:00 pēc vietējā laika.

b) ja piemēro Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkta b) apakšpunktu, kompetentās iestādes ļauj nepublicēt atsevišķa darījuma apjomu četru nedēļu pagarinātā laikposmā;

c) attiecībā uz instrumentiem, kas nav kapitāla vērtspapīru finanšu instrumenti, kas nav valsts parāds, un ja piemēro Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkta c) apakšpunktu, kompetentās iestādes uz četru nedēļu pagarinātu laikposmu ļauj atlikt vairāku darījumu apkopojuma publicēšanu, kuri izpildīti vienas kalendārās nedēļas laikā, nākamajā otrdienā līdz 9:00 pēc vietējā laika.

▼M4

_____

▼B

2. Ja ir beidzies 1. punkta b) apakšpunktā noteiktais atliktā laikposma pagarinājums, piemēro šādas prasības:

a) attiecībā uz instrumentiem, kas nav valsts parāds, publicē visu informāciju par katru atsevišķu darījumu nākamajā darbdienā līdz 9:00 pēc vietējā laika.

▼M4

_____

▼B

3. Attiecībā uz visiem instrumentiem, kas nav valsts parāds, visu informāciju par atsevišķiem darījumiem publicē četras nedēļas pēc tam, kad publicēta apkopotā informācija, saskaņā ar 1. punkta c) apakšpunktu līdz 9:00 pēc vietējā laika.

▼M4

4. Šā panta 1. un 2. punktā minētie apkopotie dienas vai nedēļas dati ietver turpmāk norādīto informāciju attiecībā uz atvasinātajiem instrumentiem par katru attiecīgā kalendārā laikposma dienu vai nedēļu:

a) vidējo svērto cenu;

b) kopējo tirgoto apjomu, kā minēts II pielikuma 4. tabulā;

c) darījumu kopskaitu.

▼B

5. Darījumus apkopo pēc *ISIN* koda. Ja *ISIN* kods nav pieejams, darījumus apkopo tās finanšu instrumentu kategorijas līmenī, kurai piemēro 13. pantā paredzēto likviditātes testu.

▼M4

6. Ja publicēšanai paredzētā nedēļas diena, kas noteikta 1. punkta c) apakšpunktā un 2. un 3. punktā, nav darbdiena, publicēšanu veic nākamajā darbdienā līdz 9.00 pēc vietējā laika.

11.a pants

Pārredzamības prasības attiecībā uz valsts parāda instrumentiem saistībā ar atliktu publicēšanu, par ko izlemj kompetentās iestādes

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkts)

1. Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkta b) apakšpunktā minētā informācijas par vairākiem darījumiem publicēšana apkopotā veidā aptver darījumus, kas izpildīti vienas kalendārās nedēļas laikā, un to veic nākamajā otrdienā līdz 9.00 pēc vietējā laika.

2. Apkopotie nedēļas dati, kas minēti 1. punktā, par katru attiecīgā kalendārā perioda nedēļu ietver šādu informāciju:

a) vidējo svērto cenu;

b) kopējo tirgoto apjomu, kā minēts II pielikuma 4. tabulā;

c) darījumu kopskaitu.

3. Darījumus apkopo pēc ISIN koda.

4. Ja publicēšanai paredzētā nedēļas diena, kas noteikta 1. punktā, nav darbdiena, publicēšanu veic nākamajā darbdienā līdz 9.00 pēc vietējā laika.

▼M3

12. pants

Pēctirdzniecības pārredzamības piemērošana konkrētiem darījumiem, kas izpildīti ārpus tirdzniecības vietas

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 21. panta 1. punkts)

Regulas (ES) Nr. 600/2014 21. panta 1. punktā minētie pienākumi neattiecas uz darījumiem, kas uzskaitīti Komisijas Deleģētās regulas (ES) 2017/590 ([1]) 2. panta 5. punktā.

▼B

IV NODAĻA

PIRMSTIRDZNIECĪBAS UN PĒCTIRDZNIECĪBAS PĀRREDZAMĪBAI KOPĪGIE NOTEIKUMI

13. pants

Metode pārredzamības aprēķinu veikšanai

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 9. panta 1. un 2. punkts, 11. panta 1. punkts un 22. panta 1. punkts)

1. Lai noteiktu finanšu instrumentus vai finanšu instrumentu klases, kurām nav likvīda tirgus, 6. panta un 8. panta 1. punkta b) apakšpunkta nolūkos, aktīvu klasēm piemēro šādas metodes:

a) stabili nosakot likviditāti:

i) vērtspapīroto atvasināto instrumentu aktīvu klasei, kā definēts III pielikuma 4.1. tabulā;

ii) kapitāla vērtspapīru atvasināto instrumentu šādām aktīvu apakšklasēm: akciju indeksa iespējas līgumi, akciju indeksa regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi, akciju iespējas līgumi, regulētā tirgū tirgoti/regulētā tirgū netirgoti akciju nākotnes līgumi, akciju dividenžu iespējas līgumi, akciju dividenžu regulētā tirgū tirgoti/regulēta tirgū netirgoti nākotnes līgumi, dividenžu indeksa iespējas līgumi, dividenžu indeksa regulētā tirgū tirgoti/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi, svārstīguma indeksa iespējas līgumi, svārstīguma indeksa regulētā tirgū tirgoti/regulēta tirgū netirgoti nākotnes līgumi, biržā tirgotu fondu iespējas līgumi, biržā tirgotu fondu regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi un citi kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti, kā noteikts III pielikuma 6.1. tabulā;

iii) ārvalstu valūtas atvasināto instrumentu aktīvu klasei, kā definēts III pielikuma 8.1. tabulā;

▼M4

iv) citu procentu likmju atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasēm, citiem preču atvasinātajiem instrumentiem, citiem kredītu atvasinātajiem instrumentiem, citiem C10 atvasinātajiem instrumentiem, citiem līgumiem par cenu starpībām, un citiem emisijas kvotu atvasinātajiem instrumentiem, kā minēts III pielikuma 5.1., 7.1., 9.1., 10.1., 11.1. un 13.1. tabulā.

([1]) Komisijas Deleģētā regula (ES) 2017/590 (2016. gada 28. jūlijs), ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 600/2014 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem ziņošanai par darījumiem kompetentajām iestādēm (OV L 87, 31.3.2017., 449. lpp.).

▼B

b) veicot periodisku novērtējumu, pamatojoties uz kvantitatīviem un, ja piemērojams, kvalitatīviem likviditātes kritērijiem, par

▼M4

_____

▼B

iii) procentu likmju atvasināto instrumentu aktīvu klasei, izņemot citu procentu likmju atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasi, kā definēts III pielikuma 5.1. tabulā;

iv) šādām kapitāla vērtspapīru atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasēm: mijmaiņas darījumiem un portfeļa mijmaiņas darījumiem, kā definēts III pielikuma 6.1. tabulā;

v) preču atvasināto instrumentu aktīvu klasei, izņemot citu preču atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasi, kā definēts III pielikuma 7.1. tabulā;

vi) šādām kredītu atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasēm: indeksa kredītriska mijmaiņas līgumiem un ar vienu parādnieku saistīta kredītriska mijmaiņas līgumiem, kā definēts III pielikuma 9.1. tabulā;

vii) *C10* atvasināto instrumentu aktīvu klasei, izņemot citu *C10* atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasi, kā definēts III pielikuma 10.1. tabulā;

viii) šādām līgumu par cenu starpībām aktīvu apakšklasēm: līgumiem par valūtas cenu starpībām un līgumiem par preču cenu starpībām, kā definēts III pielikuma 11.1. tabulā;

▼M4

_____

▼B

x) emisijas kvotu atvasināto instrumentu aktīvu klasei, izņemot citu emisijas kvotu atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasi, kā definēts III pielikuma 13.1. tabulā.

c) Veicot periodisku novērtējumu, pamatojoties uz kvalitatīviem likviditātes kritērijiem, par

i) šādām kredītu atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasēm: kredītriska mijmaiņas darījuma indeksa iespējas līgumiem un ar vienu parādnieku saistīta kredītriska mijmaiņas darījumu iespējas līgumiem, kā definēts III pielikuma 9.1. tabulā;

ii) šādām līgumu par cenu starpībām aktīvu apakšklasēm: līgumi par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām, līgumi par obligāciju cenu starpībām, līgumi par cenu starpībām par regulētā tirgū tirgotu kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumu /regulētā tirgū netirgotu kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumu un līgumi par cenu starpībām par kapitāla vērtspapīru iespējas līgumu, kā definēts III pielikuma 11.1. tabulā.

▼M4

_____

▼B

2. ►**M4** Lai noteiktu rīkojumus, kuri ir lieli pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, kā minēts 3. pantā, piemēro šādas metodes: ◄

a) robežvērtības vērtība:

▼M4

_____

▼B

ii) vērtspapīroto atvasināto instrumentu aktīvu klasei, kā definēts III pielikuma 4.2. tabulā;

iii) katrai kapitāla vērtspapīru atvasināto instrumentu apakšklasei, kā noteikts III pielikuma 6.2. un 6.3. tabulā;

iv) katrai ārvalstu valūtas atvasināto instrumentu apakšklasei, kā definēts III pielikuma 8.2. tabulā;

v) katrai apakšklasei, par kuru uzskata, ka tai nav likvīda tirgus procentu likmju atvasināto instrumentu, preču atvasināto instrumentu, kredītu atvasināto instrumentu, *C10* atvasināto instrumentu un cenu starpības līgumu aktīvu klasēm, kā definēts III pielikuma 5.3., 7.3., 9.3., 10.3. un 11.3. tabulā;

▼M4

vi) katrai aktīvu apakšklasei, par kuru uzskata, ka tai nav likvīda tirgus emisijas kvotu atvasināto instrumentu aktīvu klasēm, kā definēts III pielikuma 13.3. tabulā.

_____

▼B

b) ►M4 lielākais no tirdzniecības apjomiem, kas pārsniedz to darījumu procentuālo skaitu, kuri atbilst tirdzniecības procentīlei, un robežvērtība: ◄

▼M4

_____

▼B

ii) katrai apakšklasei, kurai ir likvīds tirgus procentu likmju atvasināto instrumentu, preču atvasināto instrumentu, kredītu atvasināto instrumentu, *C10* atvasināto instrumentu un līgumu par cenu starpībām aktīvu klasēm, kā definēts III pielikuma 5.2., 7.2., 9.2., 10.2. un 11.2. tabulā;

▼M4

iii) katrai aktīvu apakšklasei, kurai ir likvīds tirgus emisijas kvotu atvasināto instrumentu aktīvu klasēm, kā definēts III pielikuma 13.2. tabulā;

_____

▼B

3. Lai noteiktu konkrētam finanšu instrumentam raksturīgu apjomu, kā minēts 8. panta 1. punkta c) apakšpunktā, un darījumus, kas ir lieli pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, kā minēts 8. panta 1. punkta a) apakšpunktā, piemēro šādas metodes:

a) robežvērtības vērtība:

▼M4

_____

▼B

ii) vērtspapīroto atvasināto instrumentu aktīvu klasei, kā definēts III pielikuma 4.2. tabulā;

iii) katrai kapitāla vērtspapīru atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasei, kā noteikts III pielikuma 6.2. un 6.3. tabulās;

iv) katrai ārvalstu valūtas atvasināto instrumentu apakšklasei, kā definēts III pielikuma 8.2. tabulā;

v) katrai apakšklasei, par kuru uzskata, ka tai nav likvīda tirgus procentu likmju atvasināto instrumentu, preču atvasināto instrumentu, kredītu atvasināto instrumentu, *C10* atvasināto instrumentu un līgumu par cenu starpībām aktīvu klasēm, kā definēts III pielikuma 5.3., 7.3., 9.3., 10.3. un 11.3. tabulā;

▼M4

vi) katrai aktīvu apakšklasei, par kuru uzskata, ka tai nav likvīda tirgus emisijas kvotu atvasināto instrumentu aktīvu klasei, kā definēts III pielikuma 13.3. tabulā;

_____

_____

▼B

c) lielākais no tirdzniecības apjomiem, kas pārsniedz to darījumu procentuālo skaitu, kas atbilst tirdzniecības procentīlei, tirdzniecības apjoms, kas pārsniedz to darījumu procentuālo skaitu, kas atbilst apjoma procentīlei, un robežvērtība katrai apakšklasei, par kuru uzskata, ka tai ir likvīds tirgus procentu likmju atvasināto instrumentu, preču atvasināto instrumentu, kredītu atvasināto instrumentu, *C10* atvasināto instrumentu un līgumu par cenu starpībām aktīvu klasēm, kā noteikts III pielikuma 5.2., 7.2., 9.2., 10.2. un 11.2. tabulā;

▼M4

d) lielākais no tirdzniecības apjomiem, kas pārsniedz to darījumu procentuālo skaitu, kuri atbilst tirdzniecības procentīlei, un minimālā robežvērtība katrai aktīvu apakšklasei, par kuru uzskata, ka tai ir likvīds tirgus emisijas kvotu atvasinātajiem instrumentiem, kā noteikts III pielikuma 13.2. tabulā.

▼B

4. Šā panta 3. punkta c) apakšpunkta vajadzībām, ja tirdzniecības apjoms, kas atbilst apjoma procentīlei, lai noteiktu darījumu, kas ir liels pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, ir lielāks par 97,5 tirdzniecības procentīli, tirdzniecības apjomu neņem vērā, un konkrētam finanšu instrumentam raksturīgu apjomu, kā minēts 8. panta 1. punkta c) apakšpunktā, un to darījumu apjomu, kuri ir lieli pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, kā minēts 8. panta 1. punkta a) apakšpunktā, nosaka kā lielāko no tirdzniecības apjomiem, kas pārsniedz to darījumu procentuālo skaitu, kas atbilst tirdzniecības procentīlei un minimālajai robežvērtībai.

▼B

5. Saskaņā ar Deleģētajām regulām (ES) 2017/590 un (ES) 2017/577 kompetentās iestādes katru dienu apkopo datus no tirdzniecības vietām, apstiprinātām publicēšanas struktūrām un konsolidētu datu lentes nodrošinātājiem, kas ir nepieciešams aprēķinu veikšanai, lai noteiktu:

a) finanšu instrumentus un finanšu instrumentu klases, kurām nav likvīda tirgus, kā noteikts 1. punktā;

▼M4

b) lielus apjomus salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu un konkrētam instrumentam raksturīgu apjomu, kā noteikts 3. punktā.

▼M3

Pirmajā daļā minētos datus vāc saskaņā ar V pielikumu.

▼B

6. Kompetentās iestādes, kas veic aprēķinus finanšu instrumentu klasei, izveido savstarpējus sadarbības pasākumus, lai nodrošinātu aprēķiniem nepieciešamo datu apkopošanu visā Savienībā.

▼M4

7. Šā panta 1. punkta b) apakšpunkta, 2. punkta b) apakšpunkta un 3. punkta c) un d) apakšpunkta vajadzībām kompetentās iestādes ņem vērā darījumus, kas izpildīti Savienībā no iepriekšējā gada 1. janvāra līdz 31. decembrim.

8. Šā panta 2. punkta b) apakšpunkta un 3. punkta c) un d) apakšpunkta vajadzībām tirdzniecības apjomu nosaka, pamatojoties uz apjoma mēru, kā noteikts II pielikuma 4. tabulā. Ja 2. un 3. punkta nolūkā definētais tirdzniecības apjoms ir izteikts monetārā vērtībā un finanšu instruments nav denominēts *euro*, tirdzniecības apjomu konvertē valūtā, kurā minētais finanšu instruments ir denominēts, piemērojot Eiropas Centrālās bankas noteikto *euro* valūtas maiņas kursa atsauces likmi iepriekšējā gada 31. decembrī.

▼B

9. Tirgus uzturētāji un ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas uztur tirdzniecības vietu, var konvertēt tirdzniecības apjomus, kas noteikti saskaņā ar 2. un 3. punktu, par atbilstošu daļu skaitu, kā to iepriekš noteikusi attiecīgā tirdzniecības vieta attiecībā uz konkrēto apakšklasi vai aktīvu apakšklasi. Tirgus uzturētāji un ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas uztur tirdzniecības vietu, var saglabāt šādus tirdzniecības apjomus, līdz tiek piemēroti nākamo aprēķinu rezultāti, ko veic saskaņā ar 17. punktu.

▼M4

_____

11. Šā panta 2. un 3. punktā noteiktajiem apjomiem nepiemēro 2. punkta b) apakšpunktu un 3. punkta c) un d) apakšpunktu, ja aprēķinos vērā ņemto darījumu skaits nepārsniedz 1 000. Šādos gadījumos piemēro 2. punkta a) apakšpunktā un 3. punkta a) apakšpunktā norādītās robežvērtības.

▼B

12. ►M4 Izņemot, ja tie attiecas uz emisijas kvotu atvasinātajiem instrumentiem, 2. punkta b) apakšpunktā un 3. punkta c) apakšpunktā minētos aprēķinus noapaļo šādi: ◄

a) 100 000, ja robežvērtības vērtība nepārsniedz 1 miljonu;

b) 500 000, ja robežvērtības vērtība ir vienāda ar 1 miljonu vai lielāka par to, bet nepārsniedz 10 miljonus;

c) 5 miljoni, ja robežvērtības vērtība ir vienāda ar 10 miljoniem vai lielāka par to, bet nepārsniedz 100 miljonus;

d) 25 miljoni, ja robežvērtības vērtība ir vienāda ar 100 miljoniem vai lielāka par to.

13. Šā panta 1. punkta nolūkā kvantitatīvos likviditātes kritērijus, kas III pielikumā precizēti katrai aktīvu klasei, nosaka saskaņā ar III pielikuma 1. iedaļu.

▼M4

14. Attiecībā uz kapitāla vērtspapīru atvasinātajiem instrumentiem, kurus atļauts tirgot vai kurus pirmoreiz tirgo tirdzniecības vietā, kuri nepieder apakšklasei, attiecībā uz kuru ir publicēts8. panta 1. punkta c) apakšpunktā minētais konkrētam finanšu instrumentam raksturīgais apjoms un rīkojumu un tādu darījumu apjoms, kas ir lieli pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, kā minēts 3. pantā un 8. panta 1. punkta a) apakšpunktā, un kuri pieder kādai no 1. punkta a) apakšpunkta ii) punktā precizētajai aktīvu apakšklasei, konkrētam finanšu instrumentam raksturīgs apjoms un rīkojumu un tādu darījumu apjoms, kas ir lieli pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, ir apjoms, ko piemēro tādas aktīvu apakšklases vismazākās joslas vidējai dienas nosacītajai summai (*ADNA*), kurai pieder kapitāla vērtspapīru atvasinātais instruments.

15. Attiecībā uz finanšu instrumentiem, kurus atļauts tirgot vai kurus pirmoreiz tirgo tirdzniecības vietā un kuri nepieder nevienai apakšklasei, attiecībā uz ko ir publicēts 8. panta 1. punkta c) apakšpunktā minētais konkrētam finanšu instrumentam raksturīgais apjoms un rīkojumu un tādu darījumu apjoms, kuri ir lieli pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, kā minēts 3. pantā un 8. panta 1. punkta a) apakšpunktā, uzskata, ka tiem nav likvīda tirgus, līdz tiek piemēroti saskaņā ar 17. punktu veikto aprēķinu rezultāti. Piemērojamais 8. panta 1. punkta c) apakšpunktā minētais konkrētajam finanšu instrumentam raksturīgais apjoms un rīkojumu un tādu darījumu apjoms, kuri ir lieli pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, kā minēts 3. pantā un 8. panta 1. punkta a) apakšpunktā, ir to apakšklašu apjoms, par kurām ir noteikts, ka tām nav likvīda tirgus, un kuras pieder pie tās pašas aktīvu apakšklases.

▼B

16. Tirdzniecības dienas beigās, bet pirms šādas dienas beigām, tirdzniecības vietas kompetentajām iestādēm iesniedz IV pielikumā ietverto informāciju ar mērķi veikt 5. punktā minētos aprēķinus ikreiz, kad attiecīgo finanšu instrumentu atļauj tirgot vai tas tiek pirmoreiz tirgots tirdzniecības vietā, vai ikreiz, kad ir mainījusies iepriekš iesniegtā informācija.

▼M3

17. Kompetentās iestādes nodrošina, ka tiek publicēti 5. punktā minētie aprēķinu rezultāti par katru finanšu instrumentu un finanšu instrumentu klasi līdz 30. aprīlim gadā, kas seko pēc Regulas (ES) Nr. 600/2014 piemērošanas dienas, un pēc tam līdz katra gada 30. aprīlim. Aprēķinu rezultātus piemēro no katra gada jūnija pirmās pirmdienas pēc publicēšanas līdz dienai pirms nākamā gada jūnija pirmās pirmdienas.

▼M4

_____

▼B

14. pants

Darījumi, uz kuriem attiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 1. panta 6. punktā minētais atbrīvojums

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 1. panta 6. punkts)

Uzskata, ka darījumu ir noslēdzis Eiropas Centrālo banku sistēmas (ECBS) dalībnieks, īstenojot monetāro, valūtas maiņas kursa un finanšu stabilitātes politiku, ja attiecīgais darījums atbilst jebkurai no šādām prasībām:

a) darījumu veic monetārās politikas nolūkā, tostarp operācija, kas veikta saskaņā ar Eiropas Centrālo banku sistēmas un Eiropas Centrālās bankas Statūtu, kas pievienoti Līgumam par Eiropas Savienību, 18. un 20. pantu, vai operācija, kas veikta saskaņā ar valsts tiesību normām ECBS dalībniekiem dalībvalstīs, kuru valūta nav euro;

b) darījums ir operācija ar valūtas maiņas kursu, tostarp operācijas, kas veiktas, lai turētu vai pārvaldītu dalībvalstu oficiālās ārvalstu valūtas rezerves, vai rezervju pārvaldības pakalpojums, ko sniedz ECBS dalībnieks centrālajām bankām citās valstīs, attiecībā uz kurām ir pagarināts atbrīvojums saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 1. panta 9. punktu;

c) darījumu veic finanšu stabilitātes politikas nolūkā.

15. pants

Darījumi, uz kuriem neattiecas Regulas (ES) Nr. 600/2014 1. panta 6. punktā minētais atbrīvojums

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 1. panta 7. punkts)

Regulas (ES) Nr. 600/2014 1. panta 6. punktu nepiemēro šādiem darījumu veidiem, kurus noslēdzis ECBS dalībnieks, lai veiktu investīciju operāciju, kas nav saistīta ar kāda no minētā dalībnieka uzdevuma veikšanu, kā minēts 14. pantā:

a) darījumi, kas noslēgti, lai pārvaldītu pašu kapitālu;

▼B

b) darījumi, kas noslēgti administratīvos nolūkos vai ECBS dalībnieka darbiniekam, tostarp darījumi, kurus veicis darbinieku pensiju shēmas pārvaldnieks;

c) darījumi, kas noslēgti savam ieguldījumu portfelim saskaņā ar pienākumiem, kas noteikti valsts tiesību aktos.

▼M4

16. pants

Pārredzamības pienākumu pagaidu apturēšana

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 9. panta 4. punkts)

1. Attiecībā uz finanšu instrumentiem, kuriem ir likvīds tirgus, kā noteikts saskaņā ar 6.a pantā izklāstīto metodi obligācijām, strukturētā finansējuma produktiem un emisiju kvotām un saskaņā ar 13. pantā izklāstīto metodi atvasinātajiem instrumentiem, kompetentās iestādes var uz laiku apturēt Regulas (ES) Nr. 600/2014 8., 8.a un 10. pantā minētos pienākumus, ja attiecībā uz obligāciju, strukturētā finansējuma produktu, emisijas kvotu vai atvasināto instrumentu klasi kopapjoms, kā definēts II pielikuma 4. tabulā, kas aprēķināts par iepriekšējām 30 kalendārajām dienām, ir mazāk nekā 40 % no vidējā mēneša apjoma, kas aprēķināts par 12 pilniem kalendārajiem mēnešiem, kuriem seko minētās 30 kalendārās dienas.

2. Attiecībā uz finanšu instrumentiem, kuriem nav likvīda tirgus, kā noteikts saskaņā ar 6.a pantā izklāstīto metodi obligācijām, strukturētā finansējuma produktiem un emisiju kvotām un saskaņā ar 13. pantā izklāstīto metodi atvasinātajiem instrumentiem, kompetentās iestādes var uz laiku apturēt Regulas (ES) Nr. 600/2014 8., 8.a un 10. pantā minētos pienākumus, ja attiecībā uz obligāciju, strukturētā finansējuma produktu, emisijas kvotu vai atvasināto instrumentu klasi kopapjoms, kā definēts II pielikuma 4. tabulā, kas aprēķināts par iepriekšējām 30 kalendārajām dienām, ir mazāk nekā 20 % no vidējā mēneša apjoma, kas aprēķināts par 12 pilniem kalendārajiem mēnešiem, kuriem seko minētās 30 kalendārās dienas.

3. Kompetentās iestādes, veicot 1. un 2. punktā minētos aprēķinus, ņem vērā darījumus, kas izpildīti visās vietās Savienībā, ar attiecīgo obligāciju, strukturētā finansējuma produktu, emisijas kvotu vai atvasināto instrumentu klasi. Kompetentās iestādes šos aprēķinus veic tās finanšu instrumentu klases līmenī, kurai piemēro 6.a pantā noteikto likviditātes pārbaudi obligācijām, strukturētā finansējuma produktiem un emisijas kvotām un 13. pantā noteikto likviditātes pārbaudi atvasinātajiem instrumentiem.

4. Pirms kompetentās iestādes izlemj apturēt pārredzamības pienākumus, tās pārbauda, vai būtiska likviditātes samazināšanās visās tirdzniecības vietās nav sekas, ko ir izraisījusi finanšu instrumentu attiecīgās klases sezonālā ietekme uz likviditāti.

▼B

19. pants

Stāšanās spēkā un piemērošana

Šī regula stājas spēkā divdesmitajā dienā pēc tās publicēšanas *Eiropas Savienības Oficiālajā Vēstnesī*.

To piemēro no 2018. gada 3. janvāra. Tomēr 18. pantu piemēro no šīs regulas spēkā stāšanās dienas.

Šī regula uzliek saistības kopumā un ir tieši piemērojama visās dalībvalstīs.

▼**M4**

I PIELIKUMS

Sistēmas veidi un ar tiem saistītā informācija, kas jādara publiski pieejama saskaņā ar 2. pantu

Sistēmas veids	Informācija, kas jādara publiski pieejama
Nepārtrauktu rīkojumu reģistra tirdzniecības sistēma	Attiecībā uz katru finanšu instrumentu – rīkojumu kopējais skaits un to apjoms katrā cenu līmenī par vismaz pieciem labākajiem pirkšanas un pārdošanas cenu līmeņiem.
Periodisko izsoļu tirdzniecības sistēma	Attiecībā uz katru finanšu instrumentu – cena, kas izsoļu tirdzniecības sistēmā vislabāk atbilstu tās tirdzniecības algoritmam, un apjoms, ko, iespējams, varētu izpildīt minētās sistēmas dalībnieki par minēto cenu.

▼B

II PIELIKUMS

Sīkāka informācija par darījumiem, kas jādara publiski pieejama

1. tabula

2. tabulas simbolu tabula

SIMBOLS	DATU TIPS	DEFINĪCIJA
{ALPHANUM-n}	Līdz n burtciparu zīmēm	Brīvas formas teksta lauks.
{CURRENCYCODE_3}	3 burtciparu zīmes	Valūtas trīsburtu kods, kā definēts *ISO* 4217.
{DATE_TIME_FORMAT}	Datuma un laika formāts saskaņā ar *ISO* 8601	Datums un laiks šādā formātā: GGGG-MM-DDThh:mm:ss.dddddd Z. kur: — “GGGG” ir gads, — “MM” ir mēnesis, — “DD” ir diena, — “T” nozīmē, ka ir jāizmanto burts “T”, — “hh” ir stunda, — “mm” ir minūte, — “ss.dddddd” ir sekunde un sekundes daļas, — Z ir koordinētais universālais laiks. Datumus un laikus norāda pēc koordinētā universālā laika.
{DECIMAL-n/m}	Decimālskaitlis, kas sastāv no maksimāli n zīmēm, no kurām maksimāli m zīmes var būt cipari aiz komata	Ciparu lauks gan pozitīvām, gan negatīvām vērtībām: — decimāldaļas atdala ar “,” (komats); — negatīviem skaitļiem priekšā norāda “-” (mīnusa zīme); Attiecīgā gadījumā vērtības noapaļo un nesaīsina.
{ISIN}	12 burtciparu zīmes	*ISIN* kods, kā definēts *ISO* 6166.
{MIC}	4 burtciparu zīmes	Tirgus identifikators, kas definēts *ISO* 10383.

▼M4

2. tabula

Sīkas informācijas saraksts pēctirdzniecības pārredzamības nolūkā

Publicētie lauku nosaukumi (sleju galvenes) ir identiski 2. tabulā norādītajam lauka identifikatoram.

Nr.	Lauka identifikators	Finanšu instrumenti	Publicējamais apraksts un informācija	Izpildes vai publicēšanas vietas veids	Formāts, kas jāaizpilda, kā norādīts 1. tabulā
1.	Tirdzniecības datums un laiks	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Datums un laiks, kad darījums tika izpildīts. Attiecībā uz darījumiem, kas izpildīti tirdzniecības vietā, – detalizācijas līmenis atbilst prasībām, kas noteiktas Deleģētās regulas (ES) 2025/1155 ([1]) 12. pantā. Attiecībā uz darījumiem, kas nav izpildīti tirdzniecības vietā, – datums un laiks, kad puses vienojas par šādu lauku saturu: daudzums, cena, valūtas (kā noteikts Deleģētās regulas (ES) 2017/590 I pielikuma 2. tabulas 31., 34. un 44. laukā), attiecīgā gadījumā – instrumenta identifikācijas kods, instrumenta klasifikācija un pamatā esošā instrumenta kods. Attiecībā uz darījumiem, kas nav izpildīti tirdzniecības vietā, – paziņotais laiks ir detalizēts vismaz līdz tuvākajai sekundei. Ja darījuma pamatā ir rīkojums, ko trešai personai nodevusi izpildošā sabiedrība klienta vārdā, ja nebija ievēroti nodošanas nosacījumi, kas izklāstīti Deleģētās regulas (ES) 2017/590 4. pantā, šis ir darījuma datums un laiks, nevis rīkojuma nodošanas laiks.	Regulēts tirgus (RT) Daudzpusēja tirdzniecības sistēma (DTS) Organizēta tirdzniecības sistēma (OTS) Apstiprināta publicēšanas struktūra (APS)	{DATE_TIME_ FORMAT}
2.	Instrumenta identifikācijas kods	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Kods, ko izmanto finanšu instrumenta identificēšanai	RT, DTS, OTS, KDLN	{ISIN}

▼M4

Nr.	Lauka identifikators	Finanšu instrumenti	Publicējamais apraksts un informācija	Izpildes vai publicēšanas vietas veids	Formāts, kas jāaizpilda, kā norādīts 1. tabulā
3.	Cena	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Darījuma tirdzniecības cena, izņemot (ja piemērojams) komisijas maksu un uzkrātos procentus. Tirdzniecības cenu uzrāda saskaņā ar pieņemto tirgus praksi. Šajā laukā uzrādītā vērtība saskan ar vērtību, kas norādīta laukā "Cenas apzīmējums". Ja cena pašlaik nav pieejama, bet vēl tiks noteikta, ("PNDG") vai nav piemērojama ("NOAP"), šo lauku neaizpilda.	RT, DTS, OTS, KDLN	{DECIMAL-18/13}, ja cena ir izteikta kā monetāra vērtība. {DECIMAL-11/10}, ja cena ir izteikta procentuālā izteiksmē vai kā ienesīgums. {DECIMAL-18/17}, ja cena ir izteikta bāzes punktos.
4.	Cena nav norādīta	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Ja cena pašlaik nav pieejama, bet vēl tiks noteikta, vērtība ir "PNDG". Ja cena nav piemērojama, vērtība ir "NOAP".	RT, DTS, OTS, KDLN	"PNDG", ja cena nav pieejama. "NOAP", ja cena nav piemērojama.
5.	Cenas valūta	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Lielākā valūta, kurā ir izteikta cena (piemēro tikai, ja cena ir izteikta kā monetārā vērtība).	RT, DTS, OTS, KDLN	{CURRENCY CODE_3}
6.	Cenas apzīmējums	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Norāde par to, vai cena ir izteikta monetārā vērtībā, procentos, bāzes punktos vai ienesīgumā Cenas apzīmējumu uzrāda saskaņā ar pieņemto tirgus praksi. Kredītriska mijmaiņas līgumiem šo lauku aizpilda ar "BAPO". Obligācijām (izņemot biržā tirgotas parādzīmes un biržā tirgotas preces) šo lauku aizpilda ar procentuālo daļu ("PERC") no nosacītās summas. Ja cena procentos nav pieņemtā tirgus prakse, to aizpilda ar "YIEL", "BAPO" vai "MONE" saskaņā ar pieņemto tirgus praksi. Šajā laukā uzrādītā vērtība saskan ar vērtību, kas norādīta laukā "Cena". Ja cena ir uzrādīta naudas izteiksmē, to norāda lielākās valūtas vienībās.	RT, DTS, OTS, KDLN	"MONE" – monetāra vērtība "PERC" – procenti "YIEL" – ienesīgums "BAPO" – bāzes punkti

▼M4

Nr.	Lauka identifikators	Finanšu instrumenti	Publicējamais apraksts un informācija	Izpildes vai publicēšanas vietas veids	Formāts, kas jāaizpilda, kā norādīts 1. tabulā
			Ja cena pašlaik nav pieejama, bet vēl tiks noteikta, (“PNDG”) vai nav piemērojama (“NOAP”), šo lauku neaizpilda.		
7.	Daudzums	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem, izņemot gadījumos, kas aprakstīti šīs regulas 11. panta 1. punkta a) un b) apakšpunktā.	Attiecībā uz finanšu instrumentiem, ko tirgo vienībās, finanšu instrumenta vienību skaits. Citos gadījumos tukšs.	RT, DTS, OTS, KDLN	{DECIMAL- 18/17}
8.	Daudzums mērvienībās	Līgumiem, kas izteikti vienībās – preču atvasinātie instrumenti, C10 atvasinātie instrumenti, emisiju kvotu atvasinātie instrumenti un emisiju kvotas, izņemot gadījumos, kas minēti šīs regulas 11. panta 1. punkta a) un b) apakšpunktā.	Līdzvērtīgais tirgoto preču vai emisiju kvotu daudzums, kas izteikts mērvienībās.	RT, DTS, OTS, KDLN	{DECIMAL- 18/17}
9.	Daudzuma apzīmējums mērvienībā	Līgumiem, kas izteikti vienībās – preču atvasinātie instrumenti, C10 atvasinātie instrumenti, emisiju kvotu atvasinātie instrumenti un emisiju kvotas, izņemot gadījumos, kas minēti šīs regulas 11. panta 1. punkta a) un b) apakšpunktā.	Norāde par apzīmējumu, kādā izsaka daudzumu mērvienībās.	RT, DTS, OTS, KDLN	“TOCD” – oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas jebkuram līgumam, kas saistīts ar emisijas kvotām “TONE” – metriskās tonnas “MWHO” – megavatstundas “MBTU” – viens miljons britu siltumvienību “THMS” – siltumvienības “DAYS” – dienas vai {ALPHANUM-4} citos gadījumos

▼M4

Nr.	Lauka identifikators	Finanšu instrumenti	Publicējamais apraksts un informācija	Izpildes vai publicēšanas vietas veids	Formāts, kas jāaizpilda, kā norādīts 1. tabulā
10.	Nosacītā summa	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem, izņemot gadījumos, kas aprakstīti šīs regulas 11. panta 1. punkta a) un b) apakšpunktā.	Šo lauku aizpilda ar šādu informāciju: i) attiecībā uz obligācijām (izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes) – nominālvērtība, kas ir ieguldītājam atmaksātā summa dzēšanas laikā; ii) attiecībā uz biržā tirgotām precēm, biržā tirgotām parādzīmēm un vērtspapīrotiem atvasinātajiem instrumentiem – to instrumentu skaits, ar kuriem apmainījušies pircēji un pārdevēji, kas reizināts ar tā instrumenta cenu, ar kuru apmainījušies pircēji un pārdevēji, konkrētajā darījumā. Tāpat – cenas lauks, kas reizināts ar daudzuma lauks; iii) attiecībā uz strukturētā finansējuma produktiem (SFP) – vienības nominālvērtība, kas reizināta ar instrumentu skaitu darījuma brīdī; iv) attiecībā uz kredītriska mijmaiņas darījumiem – nosacītā summa, par kuru iegādāta vai pārdota aizsardzība; v) attiecībā uz iespējas līgumiem, mijmaiņas iespējas līgumiem, mijmaiņas darījumiem, kas nav minēti iv) apakšpunktā, regulētā tirgū tirgotiem nākotnes līgumiem un regulētā tirgū netirgotiem nākotnes līgumiem – attiecīgā līguma nosacītā summa; vi) attiecībā uz emisijas kvotām – no daudzuma izrietošā summa saskaņā ar attiecīgo līgumā noteikto cenu darījuma brīdī. Tāpat – cenas lauks, kas reizināts ar daudzumu mērvienības laukā; vii) attiecībā uz cenas starpības derībām – monetārā vērtība, par kuru noslēgtas derības uz katru pamatā esošā finanšu instrumenta punkta kustību darījuma brīdī;	RT, DTS, OTS, KDLN	{DECIMAL-18/5}

▼M4

Nr.	Lauka identifikators	Finanšu instrumenti	Publicējamais apraksts un informācija	Izpildes vai publicēšanas vietas veids	Formāts, kas jāaizpilda, kā norādīts 1. tabulā
			viii) attiecībā uz cenas starpības līgumiem – to instrumentu skaits, ar kuriem apmainījušies pircēji un pārdevēji, kas reizināts ar tā instrumenta cenu, ar kuru apmainījušies pircēji un pārdevēji, konkrētajā darījumā. Tāpat – cenas lauks, kas reizināts ar daudzuma lauku.		
11.	Nosacītā valūta	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem, izņemot gadījumos, kas aprakstīti šīs regulas 11. panta 1. punkta a) un b) apakšpunktā.	Lielākā valūta, kurā ir denominēta nosacītā summa. Ārvalstu valūtas atvasinātā instrumenta līguma vai vairāku valūtu mijmaiņas līguma, vai mijmaiņas iespējas līguma gadījumā, ja pamatā esošais mijmaiņas darījums ir vairāku valūtu vai valūtas cenas starpības līgums, vai cenas starpības derību līgums, tā būs darījuma 1. posma nosacītā valūta.	RT, DTS, OTS, KDLN	{CURRENCY CODE_3}
12.	[svītrots]				
13.	Izpildes vieta	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Darījuma izpildes vietas identifikācija. Izmanto *ISO* 10383 segmenta tirgus identifikācijas kodu (*MIC*) darījumiem, kurus izpilda ES tirdzniecības vietā. Ja segmenta *MIC* nav, izmanto operatīvo *MIC*. Izmanto “SINT” finanšu instrumentiem, kurus atļauts tirgot vai kuri tiek tirgoti tirdzniecības vietā, ja darījums ar konkrēto finanšu instrumentu ir veikts sistemātiskajā internalizētājā. Izmanto *MIC* kodu “XOFF” finanšu instrumentiem, kurus atļauts tirgot vai kuri tiek tirgoti tirdzniecības vietā, ja darījums ar konkrēto finanšu instrumentu netiek veikts ne ES tirdzniecības vietā, ne sistemātiskajā internalizētājā. Ja darījums tiek veikts organizētā tirdzniecības platformā ārpus ES, tad papildus “XOFF” ir jānorāda arī lauks “Trešās valsts tirdzniecības vieta, kurā notiek izpilde”.	RT, DTS, OTS, KDLN	{MIC} – ES tirdzniecības vietas vai “SINT” – sistemātisks internalizētājs “XOFF” – citi gadījumi

▼M4

Nr.	Lauka identifikators	Finanšu instrumenti	Publicējamais apraksts un informācija	Izpildes vai publicēšanas vietas veids	Formāts, kas jāaizpilda, kā norādīts 1. tabulā
14.	Trešās valsts tirdzniecības vieta, kurā notiek izpilde	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Tās trešās valsts tirdzniecības vietas identifikācija, kurā darījums tika izpildīts. Izmanto *ISO* 10383 segmentu *MIC*. Ja segmenta *MIC* nav, izmanto operatīvo *MIC*. Ja darījums netiek izpildīts trešās valsts tirdzniecības vietā, lauku neaizpilda.	APS	{MIC}
15.	Publicēšanas datums un laiks	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Datums un laiks, kad darījumu publicēja tirdzniecības vieta vai APS. Attiecībā uz darījumiem, kas izpildīti tirdzniecības vietā, – detalizācijas līmenis atbilst prasībām, kas noteiktas Deleģētās regulas (ES) 2025/1155 12. pantā. Attiecībā uz darījumiem, kas nav izpildīti tirdzniecības vietā, – paziņotais laiks ir detalizēts vismaz līdz tuvākajai sekundei.	RT, DTS, OTS, KDLN	{DATE_TIME_ FORMAT}
16.	Publicēšanas vieta	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Kods, ko izmanto, lai identificētu tirdzniecības vietu un APS, kas publicē darījumu.	RT, DTS, OTS, KDLN	{MIC}
17.	Darījuma identifikācijas kods	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Burtciparu kods, ko piešķīrušas tirdzniecības vietas (ievērojot 12. pantu Komisijas Deleģētajā regulā (ES) 2017/580 ([2])) un APS, un ko izmanto visās turpmākās atsaucēs uz šo konkrēto darījumu.	RT, DTS, OTS, KDLN	{ALPHA NUMERICAL-52}
18.	Darījumi, kuriem jāveic tīrvērte	Attiecībā uz atvasinātajiem instrumentiem	Kods, kas identificē, vai darījumam veiks tīrvērti.	RT, DTS, OTS, KDLN	“TRUE” – darījumam nav jāveic tīrvērte “FALSE” – darījumam nav jāveic tīrvērte

▼M4

Nr.	Lauka identifikators	Finanšu instrumenti	Publicējamais apraksts un informācija	Izpildes vai publicēšanas vietas veids	Formāts, kas jāaizpilda, kā norādīts 1. tabulā
19.	Karodziņi	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Viens vai vairāki lauki jāaizpilda ar piemērojamiem karodziņiem, kā aprakstīts II pielikuma 3. tabulā. Ja nav piemērojams neviens no konkrētajiem apstākļiem, darījums būtu jāpublicē bez karodziņa. Ja ir iespējama karodziņu kombinācija un tie tiek paziņoti vienā laukā, tie jāatdala ar komatiem.	RT, DTS, OTS, KDLN	Kā precizēts II pielikuma 3. tabulā
20.	Tirdzniecības sistēma	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Tirdzniecības sistēmas veids, kurā darījums tika izpildīts. Ja lauku “Izpildes vieta” aizpilda ar “SINT” vai “XOFF”, šo lauku neaizpilda.	RT, DTS, OTS	“CLOB” – centralizēta ierobežotu rīkojumu reģistra tirdzniecības sistēma. “QDTS” – cenu piedāvājuma virzītas sistēmas, t. i., sistēma, kurā darījumi tiek slēgti, pamatojoties uz stabiliem cenu piedāvājumiem, ko pastāvīgi dara pieejamus dalībniekiem, un kurā tirgus uzturētājiem cenu piedāvājumi jāuztur tādā apjomā, kas līdzsvaro locekļu un dalībnieku vajadzības veikt darījumus komerciālos apjomos un ar risku, ko uzņemas attiecīgais tirgus uzturētājs. “PATS” – periodisko izsoļu tirdzniecības sistēmas. “RFQT” – cenu piedāvājumu pieprasīšanas tirdzniecības sistēmas, t. i., tirdzniecības sistēma, kurā cenas piedāvājumu vai cenu piedāvājumus sniedz pēc viena vai vairāku locekļu vai dalībnieku pieprasījuma. Cenas piedāvājumu var izpildīt vienīgi pieprasītājs loceklis vai tirgus dalībnieks. Pieprasītājs loceklis vai dalībnieks var noslēgt darījumu, pieņemot tam pēc pieprasījuma sniegto cenas piedāvājumu vai cenu piedāvājumus.

▼M4

Nr.	Lauka identifikators	Finanšu instrumenti	Publicējamais apraksts un informācija	Izpildes vai publicēšanas vietas veids	Formāts, kas jāaizpilda, kā norādīts 1. tabulā
					“VOIC” – balss tirdzniecības sistēma, t. i., tirdzniecības sistēma, kurā darījumi starp dalībniekiem tiek kārtoti balss sarunu veidā. “HYBR” – hibrīda tirdzniecības sistēma, t. i., sistēma, kas atbilst diviem vai vairākiem iepriekš minētajiem tirdzniecības sistēmu veidiem. “OTHR” – jebkura cita tirdzniecības sistēma, t. i., jebkura cita veida tirdzniecības sistēma, kas nav minēta iepriekš.
21.	Darījumu skaits	Attiecībā uz valsts parāda instrumentiem	Šajā laukā būtu jānorāda izpildīto darījumu skaits, ja saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkta b) apakšpunktu ir nepieciešams atlikt informācijas publicēšanu par vairākiem darījumiem apkopotā veidā.	RT, DTS, OTS, KDLN	{DECIMAL-18/17}.

([1]) Komisijas Deleģētā regula (ES) 2025/1155 (2025. gada 12. jūnijs), ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 600/2014 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem, kuros precizē konsolidēto datu lenšu ievaddatus un izvaddatus, uzņēmējdarbības pulksteņu sinhronizāciju un ienākumu pārdali, ko veic akcijām un biržā tirgotiem fondiem paredzētie konsolidētu datu lentes nodrošinātāji, un ar ko atceļ Komisijas Deleģēto regulu (ES) 2017/574 (OV L, 2025/1155, 3.11.2025., ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2025/1155/oj).

([2]) Komisijas Deleģētā regula (ES) 2017/580 (2016. gada 24. jūnijs), ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 600/2014 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par attiecīgu datu, kuri saistīti ar finanšu instrumentu rīkojumiem, saglabāšanu (OV L 87, 31.3.2017., 193. lpp., ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/580/oj).

▼M4

3. tabula

Karodziņu saraksts pēctirdzniecības pārredzamības nolūkā

PĒCTIRDZNIECĪBAS PUBLICĒŠANAS ATLIKŠANAS KARODZIŅI ATVASINĀTAJIEM INSTRUMENTIEM			
Karodziņš	Nosaukums	Izpildes vai publicēšanas vietas veids	Apraksts
“LRGS”	Karodziņš, ar ko apzīmē pēctirdzniecības darījumu, kas ir liels pēc apjoma	RT, DTS, OTS, KDLN	Darījumi, kas izpildīti saskaņā ar pēctirdzniecības liela apjoma darījuma atlikšanu.
“ILQD”	Karodziņš, ar ko apzīmē darījumu ar nelikvīdu instrumentu	RT, DTS, OTS, KDLN	Darījumi, kas izpildīti saskaņā ar to instrumentu atlikšanu, kuriem nav likvīda tirgus.
“SIZE”	Karodziņš, ar ko apzīmē pēctirdzniecības darījumu, kas pārsniedz standarta tirgus apjomu *SSTI*	RT, DTS, OTS, KDLN	Darījumi, kas izpildīti saskaņā ar pēctirdzniecības instrumentam raksturīga apjoma atlikšanu

PĒCTIRDZNIECĪBAS PUBLICĒŠANAS ATLIKŠANAS KARODZIŅI OBLIGĀCIJĀM (IZŅEMOT BIRŽĀ TIRGOTAS PARĀDZĪMES UN BIRŽĀ TIRGOTAS PRECES)			
Karodziņš	Nosaukums	Izpildes vai publicēšanas vietas veids	Apraksts
MLF1	Karodziņš, ar ko apzīmē vidēju apjomu un likviditāti	RT, DTS, OTS, KDLN	Tādi darījumi ar obligācijām, uz kurām attiecas publicēšanas atlikšana, kas piemērojama vidēja apjoma darījumiem ar finanšu instrumentu, kuram ir likvīds tirgus saskaņā ar šīs regulas 8.a panta 1. punkta a) apakšpunktu.
MIF2	Karodziņš, ar ko apzīmē vidēju apjomu un nelikviditāti	RT, DTS, OTS, KDLN	Darījumiem ar obligācijām, uz kurām attiecas publicēšanas atlikšana, kas piemērojama vidēja apjoma darījumiem ar finanšu instrumentu, kuram nav likvīda tirgus saskaņā ar šīs regulas 8.a panta 1. punkta b) apakšpunktu.
LLF3	Karodziņš, ar ko apzīmē lielu apjomu un likviditāti	RT, DTS, OTS, KDLN	Darījumiem ar obligācijām, uz kurām attiecas publicēšanas atlikšana, kas piemērojama liela apjoma darījumiem ar finanšu instrumentu, kuram ir likvīds tirgus saskaņā ar šīs regulas 8.a panta 1. punkta c) apakšpunktu.
LIF4	Karodziņš, ar ko apzīmē lielu apjomu un nelikviditāti	RT, DTS, OTS, KDLN	Darījumiem ar obligācijām, uz kurām attiecas publicēšanas atlikšana, kas piemērojama liela apjoma darījumiem ar finanšu instrumentu, kuram nav likvīda tirgus saskaņā ar šīs regulas 8.a panta 1. punkta d) apakšpunktu.

▼M4

PĒCTIRDZNIECĪBAS PUBLICĒŠANAS ATLIKŠANAS KARODZIŅI OBLIGĀCIJĀM (IZŅEMOT BIRŽĀ TIRGOTAS PARĀDZĪMES UN BIRŽĀ TIRGOTAS PRECES)

Karodziņš	Nosaukums	Izpildes vai publicēšanas vietas veids	Apraksts
VLF5	Karodziņš, ar ko apzīmē ļoti lielu apjomu un likviditāti	RT, DTS, OTS, KDLN	Darījumiem ar obligācijām, uz kurām attiecas publicēšanas atlikšana, kas piemērojama ļoti liela apjoma darījumiem ar finanšu instrumentu, kuram ir likvīds tirgus saskaņā ar šīs regulas 8.a panta 1. punkta e) apakšpunktu.
VIF5	Karodziņš, ar ko apzīmē ļoti lielu apjomu un nelikviditāti	RT, DTS, OTS, KDLN	Darījumiem ar obligācijām, uz kurām attiecas publicēšanas atlikšana, kas piemērojama ļoti liela apjoma darījumiem ar finanšu instrumentu, kuram nav likvīda tirgus saskaņā ar šīs regulas 8.a panta 1. punkta e) apakšpunktu.

PĒCTIRDZNIECĪBAS PUBLICĒŠANAS ATLIKŠANAS KARODZIŅI BIRŽĀ TIRGOTĀM PRECĒM, BIRŽĀ TIRGOTĀM PARĀDZĪMĒM, SFP, EMISIJAS KVOTĀM

Karodziņš	Nosaukums	Izpildes vai publicēšanas vietas veids	Apraksts
DEFF	Atlikšana attiecībā uz biržā tirgotām precēm, biržā tirgotām parādzīmēm, SFP un emisijas kvotām	RT, DTS, OTS, KDLN	Darījumi ar biržā tirgotām precēm, biržā tirgotām parādzīmēm, SFP un emisijas kvotām, uz kuriem attiecas atlikšana, kā noteikts šīs regulas 8.a panta 2. un 3. punktā.

PAPILDU ATLIKŠANAS KARODZIŅI ATVASINĀTAJIEM INSTRUMENTIEM

11. panta 1. punkta a) apakšpunkta i) punkts	“LMTF”	Ierobežota apjoma sīkākas informācijas karodziņš	RT, DTS, OTS, KDLN	Pirmais ziņojums ar ierobežota apjoma sīkākas informācijas publicēšanu saskaņā ar 11. panta 1. punkta a) apakšpunkta i) punktu.
	“FULF”	Pilna apjoma sīkākas informācijas karodziņš	RT, DTS, OTS, KDLN	Darījums, par kuru saskaņā ar 11. panta 1. punkta a) apakšpunkta i) punktu iepriekš tika publicēta ierobežota apjoma sīkāka informācija.
11. panta 1. punkta a) apakšpunkta ii) punkts	“DATF”	Dienas apkopoto darījumu karodziņš	RT, DTS, OTS, KDLN	Dienas kopējo darījumu publicēšana saskaņā ar 11. panta 1. punkta a) apakšpunkta ii) punktu.
	“FULA”	Pilna apjoma sīkākas informācijas karodziņš	RT, DTS, OTS, KDLN	Atsevišķi darījumi, par kuriem saskaņā ar 11. panta 1. punkta a) apakšpunkta ii) punktu iepriekš tika publicēta apkopota sīkāka informācija.

▼M4

PAPILDU ATLIKŠANAS KARODZIŅI ATVASINĀTAJIEM INSTRUMENTIEM

11. panta 1. punkta b) apakšpunkts	“VOLO”	Apjoma nepublicēšanas karodziņš	RT, DTS, OTS, KDLN	Darījums, par kuru saskaņā ar 11. panta 1. punkta b) apakšpunktu ir publicēta ierobežota apjoma sīkāka informācija.
	“FULV”	Pilna apjoma sīkākas informācijas karodziņš	RT, DTS, OTS, KDLN	Darījums, par kuru saskaņā ar 11. panta 1. punkta b) apakšpunktu iepriekš tika publicēta ierobežota apjoma sīkāka informācija.
11. panta 1. punkta c) apakšpunkts	“FWAF”	Četru nedēļu apkopojuma karodziņš	RT, DTS, OTS, KDLN	Apkopoto darījumu publicēšana saskaņā ar 11. panta 1. punkta c) apakšpunktu.
	“FULJ”	Pilna apjoma sīkākas informācijas karodziņš	RT, DTS, OTS, KDLN	Atsevišķi darījumi, uz kuriem iepriekš attiecās apkopota publicēšana saskaņā ar 11. panta 1. punkta c) apakšpunktu.

PAPILDU ATLIKŠANAS KARODZIŅI VALSTS OBLIGĀCIJĀM

11. panta 3. punkta a) apakšpunkts	“OMIS”	Apjoma nepublicēšanas karodziņš	RT, DTS, OTS, KDLN	Darījums, par kuru saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkta a) apakšpunktu ir publicēta ierobežota apjoma sīkāka informācija.
	“FULO”	Pilna apjoma sīkākas informācijas karodziņš	RT, DTS, OTS, KDLN	Darījums, par kuru saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkta a) apakšpunktu iepriekš tika publicēta ierobežota apjoma sīkāka informācija.
11. panta 3. punkta b) apakšpunkts	“AGFW”	Četru nedēļu apkopojuma karodziņš	RT, DTS, OTS, KDLN	Publicētie apkopotie darījumi saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkta b) apakšpunktu.
	“FULG”	Pilna apjoma sīkākas informācijas karodziņš	RT, DTS, OTS, KDLN	Atsevišķi darījumi, uz kuriem iepriekš attiecās apkopota publicēšana saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkta b) apakšpunktu.

CITI KARODZIŅI

Karodziņš	Nosaukums	Izpildes vai publicēšanas vietas veids	Apraksts
“BENC”	Karodziņš, ar ko apzīmē etalona darījumu	RT, DTS, OTS, KDLN	Darījums ir veikts, atsaucoties uz cenu, kas aprēķināta vairākos laika brīžos saskaņā ar konkrēto etalonu, piemēram, pēc apjoma svērtā vidējā cena vai laikā svērtā vidējā cena.
“NPFT”	Cenu neveidojoša darījuma karodziņš	RT, DTS, OTS, KDLN	Cenu neveidojoši darījumi, kā noteikts Deleģētās regulas (ES) 2017/590 2. panta 5. punktā.

▼M4

CITI KARODZIŅI

Karodziņš	Nosaukums	Izpildes vai publicēšanas vietas veids	Apraksts
“TPAC”	Karodziņš, ar ko apzīmē paketes darījumu	RT, DTS, OTS, KDLN	Paketes darījumi, kas nav apmaiņa pret fiziskiem aktīviem, kā noteikts Regulas (ES) Nr. 600/2014 2. panta 1. punkta 50) apakšpunkta b) punktā.
“XFPH”	Apmaiņas pret fiziskiem aktīviem darījuma karodziņš	RT, DTS, OTS, KDLN	Apmaiņa pret fiziskiem aktīviem, kā definēts Regulas (ES) Nr. 600/2014 2. panta 1. punkta 48) apakšpunktā.
“CANC”	Atcelšanas karodziņš	RT, DTS, OTS, KDLN	Ja ir atcelts iepriekš publicēts darījums.
“AMND”	Grozījumu karodziņš	RT, DTS, OTS, KDLN	Ja ir grozīts iepriekš publicēts darījums.
“PORT”	Portfeļa tirdzniecības karodziņš	RT, DTS, OTS, KDLN	Darījums ar pieciem vai vairākiem dažādiem finanšu instrumentiem, ja šos darījumus vienlaikus tirgo viens un tas pats klients par vienu partijas cenu un tas nav “paketes darījums”, kā definēts Regulas (ES) Nr. 600/2014 2. panta 1. punkta 50) apakšpunktā.
“MTCH”	Karodziņš, ar ko apzīmē savietotu tirdzniecību savā vārdā	OTF	Savietota tirdzniecība savā vārdā, kā to nosaka 4. panta 1. punkta 38) apakšpunkts Direktīvā 2014/65/ES par finanšu instrumentu tirgiem.
“NEGO”	Karodziņš, ar ko apzīmē nolīgtu darījumu	RT, DTS, OTS	Darījumiem, par kuriem vienošanās ir panākta privāti, bet par kuriem ziņo saskaņā ar tirdzniecības vietas noteikumiem.

▼M3

4. tabula

Apjoma mērs

Instrumenta veids	Apjoms
Visas obligācijas, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes, un strukturētus finanšu produktus	Tirgotā līguma “nosacītā summa” saskaņā ar šīs regulas II pielikuma 2. tabulas 10. lauku.
Biržā tirgotu preču un biržā tirgotu parādzīmju obligāciju veidi	Tirgotā līguma “nosacītā summa” saskaņā ar šīs regulas II pielikuma 2. tabulas 10. lauku.
Vērtspapīroti atvasinātie instrumenti	Tirgotā līguma “nosacītā summa” saskaņā ar šīs regulas II pielikuma 2. tabulas 10. lauku.
Procentu likmju atvasinātie instrumenti	Tirgotā līguma “nosacītā summa” saskaņā ar šīs regulas II pielikuma 2. tabulas 10. lauku.
Ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti	Tirgotā līguma “nosacītā summa” saskaņā ar šīs regulas II pielikuma 2. tabulas 10. lauku.
Kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti	Tirgotā līguma “nosacītā summa” saskaņā ar šīs regulas II pielikuma 2. tabulas 10. lauku.
Preču atvasinātie instrumenti	Tirgotā līguma “nosacītā summa” saskaņā ar šīs regulas II pielikuma 2. tabulas 10. lauku.
Kredīta atvasinātie instrumenti	Tirgotā līguma “nosacītā summa” saskaņā ar šīs regulas II pielikuma 2. tabulas 10. lauku.
Cenas starpības līgumi	Tirgotā līguma “nosacītā summa” saskaņā ar šīs regulas II pielikuma 2. tabulas 10. lauku.
C10 atvasinātie instrumenti	Tirgotā līguma “nosacītā summa” saskaņā ar šīs regulas II pielikuma 2. tabulas 10. lauku.
Emisiju kvotu atvasinātie instrumenti	“Daudzums mērvienībās” saskaņā ar šīs regulas II pielikuma 2. tabulas 8. lauku.
Emisijas kvotas	“Daudzums mērvienībās” saskaņā ar šīs regulas II pielikuma 2. tabulas 8. lauku.

▼B

III PIELIKUMS

Likviditātes novērtējums, *LIS* un *SSTI* robežvērtības attiecībā uz finanšu instrumentiem, kas nav kapitāla vērtspapīru finanšu instrumenti

▼M4

1. **Šajā pielikumā lieto šādas norādes.**

1. Atsauce uz apgrozībā esošo obligāciju emisijas apjomu 2.2. tabulā attiecas uz emitēto un pašlaik ieguldītāju turējumā esošo obligāciju kopējo vērtību.

2. Atsauce uz "aktīvu klasi" ir atsauce uz šādam finanšu instrumentu klasēm: obligācijas, strukturēti finanšu produkti, vērtspapīroti atvasinātie instrumenti, procentu likmju atvasinātie instrumenti, kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti, preču atvasinātie instrumenti, ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti, kredītu atvasinātie instrumenti, C10 atvasinātie instrumenti, līgumi par cenu starpībām (*CFD*), emisiju kvotas un emisiju kvotu atvasinātie instrumenti.

3. Atsauce uz "aktīvu apakšklasi" ir atsauce uz aktīvu klasi, kas iedalīta detalizētākā līmenī, pamatojoties uz līguma veidu un/vai pamatā esošā instrumenta veidu.

4. Atsauce uz "apakšklasi" ir atsauce uz aktīvu apakšklasi, kas iedalīta detalizētākā līmenī, pamatojoties uz sīkākiem kvalitatīvajiem segmentācijas kritērijiem, kā noteikts šā pielikuma 2.2.–13,3. tabulā.

5. "Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*)" ir konkrēta finanšu instrumenta kopējā nosacītā summa, ko nosaka saskaņā ar apjoma mēru, kas izklāstīts II pielikuma 4. tabulā, un ko izpilda laikposmā, kas noteikts 13. panta 7. punktā, to dalot ar tirdzniecības dienu skaitu minētajā laikposmā vai, attiecīgā gadījumā, tajā gada daļā, kurā šo finanšu instrumentu bija atļauts tirgot vai to tirgoja tirdzniecības vietā un tā tirdzniecība nebija apturēta.

6. "Dienas vidējais darījumu skaits" ir kopējais darījumu skaits, kas attiecībā uz konkrētu finanšu instrumentu izpildīti laikposmā, kas noteikts 13. panta 7. punktā, to dalot ar tirdzniecības dienu skaitu šajā laikposmā vai, attiecīgā gadījumā, tajā gada daļā, kurā finanšu instrumentu bija atļauts tirgot vai to tirgoja tirdzniecības vietā un tā tirdzniecība nebija apturēta.

7. "Regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums" ir līgums par preces vai finanšu instrumenta pirkšanu vai pārdošanu noteiktā datumā nākotnē par cenu, par kuru tika panākta vienošanās, pircējam un pārdevējam noslēdzot šo līgumu. Visiem regulētā tirgū tirgotiem nākotnes līgumiem ir standarta noteikumi, kas nosaka minimālo pirkšanas vai pārdošanas daudzumu un kvalitāti, mazāko summu, par kādu cena var mainīties, piegādes procedūras, termiņu un citas līguma īpašības.

8. "Iespējas līgums" ir līgums, kas īpašniekam dod tiesības, tomēr neuzliek saistības pirkt (*call*) vai pārdot (*put*) konkrētu finanšu instrumentu vai preci par iepriekš noteiktu cenu, iespējas līguma izmantošanas cenu (*strike* vai *exercise price*) vai nu noteiktā nākotnes datumā vai iespējas līguma izmantošanas datumā (*future date* vai *exercise date*), vai arī līdz tam.

9. "Mijmaiņas līgums" ir līgums, kurā divas puses vienojas kādā konkrētā dienā nākotnē apmainīt naudas plūsmas vienā finanšu instrumentā pret cita finanšu instrumenta naudas plūsmām.

10. "Portfeļa mijmaiņas līgums" ir līgums, saskaņā ar kuru galalietotāji var tirgoties ar vairākiem mijmaiņas līgumiem.

▼**M4**

11. “Regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums” ir privāta vienošanās starp divām pusēm par preces vai finanšu instrumenta pirkšanu vai pārdošanu noteiktā datumā nākotnē par cenu, par kuru tika panākta vienošanās, pircējam un pārdevējam noslēdzot šo līgumu.

12. “Mijmaiņas iespējas līgums” vai “mijmaiņas līgumam piesaistīts iespējas līgums” ir līgums, kas īpašniekam dod tiesības, tomēr neuzliek pienākumu noslēgt mijmaiņas līgumu vai nu noteiktā nākotnes datumā vai izpildes datumā, vai līdz noteiktam nākotnes vai izpildes datumam.

13. “Regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums par mijmaiņas līgumu” ir regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums, kas īpašniekam dod tiesības, tomēr neuzliek saistības noslēgt mijmaiņas līgumu vai nu noteiktā datumā, vai līdz noteiktam nākotnes datumam.

14. “Regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par mijmaiņas līgumu” ir regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums, kas īpašniekam dod tiesības, tomēr neuzliek saistības noslēgt mijmaiņas līgumu vai nu noteiktā datumā, vai līdz noteiktam nākotnes datumam.

▼M4

2. **Obligācijas**

2.2. tabula

Obligācijas (visi obligāciju veidi, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes) – klases, kurām nav likvīda tirgus

Par katru atsevišķu obligāciju uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6.a pantu, ja to raksturo obligācijai raksturīgo īpašību konkrēta kombinācija, kā norādīts katrā turpmāko tabulu rindā.

Valsts obligācijas un citas publiskā sektora obligācijas						
ID grupa	**FITR ID**	**Obligācijas veids**	**Emitents vai emitenta valsts**	**Atlikušais termiņš**	**Kupona veids**	**Apgrozībā esošais emisijas apjoms**
	RTS2#3	RTS2#9	Emitenta valsts, kas norādīta Komisijas Deleģētās regulas (ES) 2017/585 ([1]) (“RTS23”) laukā “Emitenta vai tirdzniecības vietas uzturētāja identifikators”	Atlikušais laiks līdz termiņa datumam, kas uzrādīts RTS23 laukā “Termiņš”	*CFI* koda trešais burts, kas norādīts RTS23 laukā “Instrumenta klasifikācija”	RTS23 lauks “Kopējā emitētā nominālvērtība”, kas konvertēta EUR
G1	BOND	EUSB EUSB ir obligācija, kas nav ne konvertējama, ne segta obligācija un ko emitējis valsts emitents: a) Savienība; b) dalībvalsts, tai skaitā dalībvalsts valdības departaments, aģentūra vai īpašam nolūkam dibināta sabiedrība; c) federālas dalībvalsts gadījumā – minētās federācijas loceklis; d) vairāku dalībvalstu īpašam nolūkam dibināta sabiedrība; e) starptautiska finanšu iestāde, kuru izveidojušas divas vai vairākas dalībvalstis un kuras uzdevums ir nodrošināt finansējumu un sniegt finanšu palīdzību tās locekļiem, kurus piemeklējušas smagas finansiāla rakstura problēmas vai kuriem tādas draud; f) Eiropas Investīciju banka; g) trešās valsts suverēna struktūra.	Emitenta valsts ir dalībvalsts, Amerikas Savienotās Valstis vai Apvienotā Karaliste; VAI Emitents ir Savienība.	Līdz 10 gadiem (ieskaitot)	F (fiksēts kupons)	Mazāk par 5 000 000 000 EUR
G2	BOND	EUSB vai OEPB OEBP ir obligācija, kas nav ne konvertējama, ne segta obligācija un ko emitējusi publiska struktūra, kas nav valsts emitents.	Visi instrumenti, kas nav minēti G1			Mazāk par 1 000 000 000 EUR

([1]) Komisijas Deleģētā regula (ES) 2017/585 (2016. gada 14. jūlijs), ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 600/2014 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par finanšu instrumentu atsauces datu standartiem un formātiem un tehniskiem līdzekļiem saistībā ar Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādes un kompetento iestāžu veicamajiem pasākumiem (OV L 87, 31.3.2017., 368. lpp., ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/585/oj).

▼M4

Uzņēmuma, konvertējamās un citas obligācijas					
ID grupa	**FITR ID**	**Obligācijas veids**	**Valūta**	**Kredītreitings**	**Apgrozībā esošais emisijas apjoms**
	RTS2#3	RTS2#9	RTS23 laukā "Nosacītā 1. valūta" uzrādītā instrumenta valūta		RTS23 lauks "Kopējā emitētā nominālvērtība", kas konvertēta EUR
G3	BOND	CRPB, CVTB vai OTHR CRPB ir obligācija, kas nav ne konvertējama, ne segta obligācija un ko emitējusi *Societas Europaea*, kas izveidota saskaņā ar Padomes Regulu (EK) Nr. 2157/2001 ([1]), vai Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2013/34/ES ([2]) I pielikumā vai II pielikumā uzskaitīts uzņēmuma veids vai tam līdzvērtīgs uzņēmuma veids trešās valstīs. CVTB ir instruments, ko veido obligācija vai vērtspapīrots parāda instruments ar iegultu atvasināto instrumentu, piemēram, iespēju iegādāties pamatā esošu kapitāla vērtspapīru.	EUR, GBP, USD	Ieguldījumu kategorija	Mazāk par 500 000 000 EUR
G4	BOND	CRPB, CVTB vai OTHR	Visi instrumenti, kas nav minēti G3		Mazāk par 500 000 000 EUR

([1]) Padomes Regula (EK) Nr. 2157/2001 (2001. gada 8. oktobris) par Eiropas uzņēmējsabiedrības (SE) statūtiem (OV L 294, 10.11.2001., 1. lpp., ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2001/2157/oj).
([2]) Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīva 2013/34/ES (2013. gada 26. jūnijs) par noteiktu veidu uzņēmumu gada finanšu pārskatiem, konsolidētajiem finanšu pārskatiem un saistītiem ziņojumiem, ar ko groza Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 2006/43/EK un atceļ Padomes Direktīvas 78/660/EEK un 83/349/EEK (OV L 182, 29.6.2013., 19. lpp., ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2013/34/oj).

Segtās obligācijas			
ID grupa	**FITR ID**	**Obligācijas veids**	**Apgrozībā esošais emisijas apjoms**
	RTS2#3	RTS2#9	RTS23 lauks "Kopējā emitētā nominālvērtība", kas konvertēta EUR
G5	BOND	CVDB CVDB ir obligācijas, kas minētas Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2009/65/EK ([1]) 52. panta 4. punktā.	Mazāk par 500 000 000 EUR

([1]) Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīva 2009/65/EK (2009. gada 13. jūlijs) par normatīvo un administratīvo aktu koordināciju attiecībā uz pārvedamu vērtspapīru kolektīvo ieguldījumu uzņēmumiem (PVKIU) (OV L 302, 17.11.2009., 32. lpp., ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2009/65/oj).

▼M4

2.3. tabula

Obligācijas (visi obligāciju veidi, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes) – pirmstirdzniecības *LIS* robežvērtības

Aktīvu klase – obligācijas (visi obligāciju veidi, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes)	
Obligācijas veids	***LIS* pirmstirdzniecība**
Valsts obligācijas un citas publiskā sektora obligācijas	5 000 000 EUR
Uzņēmuma obligācijas, konvertējamas obligācijas un citas obligācijas	1 000 000 EUR
Segtās obligācijas	5 000 000 EUR

2.4. tabula

Obligācijas (biržā tirgotu preču un biržā tirgotu parādzīmju obligāciju veidi) – klases, kurām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – obligācijas (biržā tirgotu preču un biržā tirgotu parādzīmju obligāciju veidi)	
Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6.a pantu, piemēro šādu metodi:	
Biržā tirgotas preces (*ETC*) – RTS2#3 = *ETCS*: parāda instruments, kas emitēts emitenta tiešam ieguldījumam preču vai preču atvasināto instrumentu līgumos. *ETC* cena ir tieši vai netieši saistīta ar pamatā esošā instrumenta darbības rezultātiem. *ETC* pasīvi seko tās preces vai preces indeksa darbības rezultātiem, uz ko tās attiecas.	Tiek uzskatīts, ka *ETC* nav likvīda tirgus.
Biržā tirgotas parādzīmes (*ETN*) – RTS2#3 = *ETNS*: parāda instruments, kas emitēts emitenta tiešam ieguldījumam pamatā esošos atvasinātos instrumentos vai pamatā esošo atvasināto instrumentu līgumos. *ETN* cena ir tieši vai netieši saistīta ar pamatā esošā instrumenta darbības rezultātiem. *ETN* pasīvi seko tā pamatā esošā instrumenta darbības rezultātiem, uz ko tās attiecas.	Tiek uzskatīts, ka visiem *ETN* nav likvīda tirgus.

2.5. tabula

Obligācijas (biržā tirgotu preču un biržā tirgotu parādzīmju obligāciju veidi) – pirmstirdzniecības *LIS* robežvērtības

Aktīvu klase – obligācijas (biržā tirgotu preču un biržā tirgotu parādzīmju obligāciju veidi)	
Obligācijas veids	***LIS* pirmstirdzniecība**
ETC	1 000 000 EUR
ETN	1 000 000 EUR

▼M4

2.6. tabula

Obligācijas (visi obligāciju veidi, izņemot ar biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes) – atlikšanas režīms

Aktīvu klase – obligācijas (visi obligāciju veidi, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes)			
Obligācijas veids	**Kategorija**	**Likviditāte**	**Apjoms (pārsniedz vai vienāds ar)**
Valsts obligācijas G1 kategorijā saskaņā ar 2.2. tabulu	1.	Tiek uzskatīts, ka tām ir likvīds tirgus	15 000 000 EUR
	2.	Tiek uzskatīts, ka tām nav likvīda tirgus	5 000 000 EUR
	3.	Tiek uzskatīts, ka tām ir likvīds tirgus	50 000 000 EUR
	4.	Tiek uzskatīts, ka tām nav likvīda tirgus	15 000 000 EUR
	5.	Tiek uzskatīts, ka tām ir likvīds tirgus	100 000 000 EUR
	5.	Tiek uzskatīts, ka tām nav likvīda tirgus	50 000 000 EUR
Valsts obligācijas un citas publiskā sektora obligācijas G2 kategorijā saskaņā ar 2.2. tabulu	1.	Tiek uzskatīts, ka tām ir likvīds tirgus	10 000 000 EUR
	2.	Tiek uzskatīts, ka tām nav likvīda tirgus	1 000 000 EUR
	3.	Tiek uzskatīts, ka tām ir likvīds tirgus	20 000 000 EUR
	4.	Tiek uzskatīts, ka tām nav likvīda tirgus	2 000 000 EUR
	5.	Tiek uzskatīts, ka tām ir likvīds tirgus	50 000 000 EUR
	5.	Tiek uzskatīts, ka tām nav likvīda tirgus	5 000 000 EUR
Uzņēmumu obligācijas, konvertējamas obligācijas un citas obligācijas G3 kategorijā saskaņā ar 2.2. tabulu	1.	Tiek uzskatīts, ka tām ir likvīds tirgus	1 500 000 EUR
	2.	Tiek uzskatīts, ka tām nav likvīda tirgus	500 000 EUR
	3.	Tiek uzskatīts, ka tām ir likvīds tirgus	7 500 000 EUR
	4.	Tiek uzskatīts, ka tām nav likvīda tirgus	2 000 000 EUR
	5.	Tiek uzskatīts, ka tām ir likvīds tirgus	15 000 000 EUR
	5.	Tiek uzskatīts, ka tām nav likvīda tirgus	5 000 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – obligācijas (visi obligāciju veidi, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes)			
Obligācijas veids	**Kategorija**	**Likviditāte**	**Apjoms (pārsniedz vai vienāds ar)**
Uzņēmumu obligācijas, konvertējamas obligācijas un citas obligācijas G4 kategorijā saskaņā ar 2.2. tabulu	1.	Tiek uzskatīts, ka tām ir likvīds tirgus	1 000 000 EUR
	2.	Tiek uzskatīts, ka tām nav likvīda tirgus	500 000 EUR
	3.	Tiek uzskatīts, ka tām ir likvīds tirgus	5 000 000 EUR
	4.	Tiek uzskatīts, ka tām nav likvīda tirgus	2 000 000 EUR
	5.	Tiek uzskatīts, ka tām ir likvīds tirgus	10 000 000 EUR
	5.	Tiek uzskatīts, ka tām nav likvīda tirgus	5 000 000 EUR
Segtās obligācijas G5 kategorijā saskaņā ar 2.2. tabulu	1.	Tiek uzskatīts, ka tām ir likvīds tirgus	5 000 000 EUR
	2.	Tiek uzskatīts, ka tām nav likvīda tirgus	1 000 000 EUR
	3.	Tiek uzskatīts, ka tām ir likvīds tirgus	20 000 000 EUR
	4.	Tiek uzskatīts, ka tām nav likvīda tirgus	5 000 000 EUR
	5.	Tiek uzskatīts, ka tām ir likvīds tirgus	50 000 000 EUR
	5.	Tiek uzskatīts, ka tām nav likvīda tirgus	10 000 000 EUR

3. **Strukturētā finansējuma produkti (SFP)**

3.1. tabula

SFP – klases, kurām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – strukturētā finansējuma produkti (SFP)
SFP aktīvu klases novērtējums, lai noteiktu finanšu instrumentus, par kuriem uzskata, ka tiem nav likvīda tirgus saskaņā ar 6.a pantu – RTS2#3 = SFPS.
Tiek uzskatīts, ka visiem SFP nav likvīda tirgus.

3.2. tabula

SFP – pirmstirdzniecības *LIS* robežvērtība

Aktīvu klase – strukturētā finansējuma produkti (SFP)
***LIS* pirmstirdzniecība**
250 000 EUR

▼B

4. **Vērtspapīroti atvasinātie instrumenti**

▼M3

4.1. tabula

Vērtspapīroti atvasinātie instrumenti – klases, kurām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – vērtspapīroti atvasinātie instrumenti
ir pārvedami vērtspapīri, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES 4. panta 1. punkta 44) apakšpunkta c) punktā, kas nav strukturētā finansējuma produkti, un tie ietver vismaz:
a.1) tradicionālās segtās garantijas, kas ir vērtspapīri, kurus emitējusi finanšu iestāde un kuri turētājam dod tiesības, bet ne pienākumu: a) iegādāties konkrētu pamatā esošā aktīva apjomu termiņa beigās vai līdz termiņa beigām par iepriekš noteiktu norunas cenu vai, ja ir fiksēts norēķins skaidrā naudā, no pārdevēja saņemt maksājumu, kas ir pozitīva starpība starp pašreizējo tirgus cenu un norunas cenu; vai b) termiņa beigās vai līdz termiņa beigām pārdot konkrētu pamatā esošā aktīva apjomu par iepriekš noteiktu norunas cenu vai, ja ir fiksēts norēķins skaidrā naudā, no pircēja saņemt maksājumu, kas ir pozitīva starpība starp norunas cenu un pašreizējo tirgus cenu;
a.2) garantijas, kas ir vērtspapīri, kurus emitējis tas pats pamatā esošā aktīva emitents, kas turētājam dod tiesības, bet ne pienākumu: a) termiņa beigās vai līdz termiņa beigām pirkt konkrētu pamatā esošā aktīva apjomu par iepriekš noteiktu norunas cenu vai, ja ir fiksēts norēķins skaidrā naudā, no pārdevēja saņemt maksājumu, kas ir pozitīva starpība starp pašreizējo tirgus cenu un norunas cenu; vai b) termiņa beigās vai līdz termiņa beigām pārdot konkrētu pamatā esošā aktīva apjomu par iepriekš noteiktu norunas cenu vai, ja ir fiksēts norēķins skaidrā naudā, no pircēja saņemt maksājumu, kas ir pozitīva starpība starp norunas cenu un pašreizējo tirgus cenu;
b) sviras sertifikāti ir sertifikāti, kas seko pamatā esoša aktīva darbības rezultātiem ar sviras efektu;
c) netradicionālas segtas garantijas ir segtas garantijas, kuru galvenais komponents ir iespējas līgumu kombinācija;
d) pārvedamas tiesības (*negotiable rights*), kuru pamatā ir instruments, kas nav kapitāla vērtspapīru instruments;
e) ieguldījuma sertifikāti ir sertifikāti, kas seko pamatā esoša aktīva darbības rezultātiem bez sviras efekta.
RTS2#3 = SDRV
Lai noteiktu finanšu instrumentu klasi, par kuru uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi
tiek uzskatīts, ka visiem vērtspapīrotiem atvasinātiem instrumentiem ir likvīds tirgus

▼M4

4.2. tabula

Vērtspapīroti atvasinātie instrumenti – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības

Aktīvu klase – vērtspapīroti atvasinātie instrumenti		
Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības		
***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

▼B

5. **Procentu likmju atvasinātie instrumenti**

▼M3

5.1. tabula

Procentu likmju atvasinātie instrumenti – klases, kurām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti				
jebkurš līgums, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma C iedaļas 4. punktā, kura galīgais pamatā esošais instruments ir procentu likme, obligācija, aizdevums, jebkurš grozs, portfelis vai indekss, kas ietver procentu likmi, obligāciju, aizdevumu vai jebkuru citu produktu, kas ataino procentu likmes, obligācijas vai aizdevuma darbības rezultātus.				
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju**		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
Regulētā tirgū tirgoti obligāciju nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti obligāciju nākotnes līgumi **/Regulētā tirgū tirgotam obligāciju nākotnes līgumam piesaistīts regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums**	regulētā tirgū tirgotu obligāciju nākotnes līgumu/regulētā tirgū netirgotu obligāciju nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS2#17) – pamatā esoša instrumenta emitents **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#18) – turpmāk definēts pamatā esošas piegādājamas obligācijas termiņš	5 000 000 EUR	10	ikreiz, kad par kādu apakšklasi tiek konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus attiecībā uz konkrētu laiku, kāds atlicis līdz termiņam, un par to apakšklasi, kuru definē saskaņā ar nākamo termiņu

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
/Regulētā tirgū tirgotam obligāciju nākotnes līgumam piesaistīts regulētā tirgū netirgots nākotnes līgumsObligācijai piesaistīts regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = BOND** **vai** **Obligācijai piesaistīts regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FORW** **RTS2#16 = BOND** **vai** **Regulētā tirgū tirgotam obligāciju nākotnes līgumam piesaistīts regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR**	**Īstermiņa:** tiek uzskatīts, ka pamatā esoša piegādājama obligācija ar termiņu līdz 4 gadiem ir īstermiņa obligācija**Vidējā termiņa:** tiek uzskatīts, ka pamatā esoša piegādājama obligācija ar termiņu no 4 līdz 8 gadiem ir vidēja termiņa obligācija **Ilgtermiņa:** tiek uzskatīts, ka pamatā esoša piegādājama obligācija ar termiņu no 8 līdz 15 gadiem ir ilgtermiņa obligācija **Īpaša ilgtermiņa:** tiek uzskatīts, ka pamatā esoša piegādājama obligācija ar termiņu virs 15 gadiem ir īpaša ilgtermiņa obligācija **3. segmentācijas kritērijs** – līdz termiņam atlikušais laiks regulētā tirgū tirgota nākotnes līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 2. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 3. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads, 4. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi, 5. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi			grupu, tiek konstatēts, ka tai nav likvīda tirgus, uzskata, ka pirmajam līgumam ar vistālāko termiņu (*back month*) ir likvīds tirgus divas nedēļas līdz līguma ar vistuvāko termiņu (*front month*) beigām

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
RTS2#5 = FUTR **RTS2#16 = BNFD** **vai** **Regulētā tirgū tirgotam obligāciju nākotnes līgumam piesaistīts regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FORW** **RTS2#16 = BNFD**				
Obligāciju iespējas līgums **/Obligāciju iespējas līgumam piesaistīts iespējas līgums** **/Regulētā tirgū tirgotam obligāciju nākotnes līgumam piesaistīts iespēju līgums** **Obligāciju iespējas līgums** **Obligāciju iespējas līgumam piesaistīts iespējas līgums** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR**	obligāciju iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS2#22) – galīgā pamatā esošā obligācija **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks iespējas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 2. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 3. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads 4. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi 5. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	5 000 000 EUR	10	

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs
RTS2#5 = OPTN **RTS2#16 = BOND** **vai** **Obligāciju iespējas līgumam piesaistīts iespējas līgums** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = BOND** **vai** **Regulētā tirgū tirgotam obligāciju nākotnes līgumam piesaistīts iespējas līgums** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = BNFD**				

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
Regulētā tirgū tirgoti procentu likmes nākotnes līgumi un regulētā tirgū netirgoti procentu likmes nākotnes līgumi/Regulētā tirgū tirgotam procentu likmes nākotnes līgumam piesaistīts regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/ Regulētā tirgū tirgotam procentu likmes nākotnes līgumam piesaistīts regulētā tirgū netirgots procentu likmes nākotnes līgums **Procentu likmei piesaistīts regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = INTR** **vai** **Regulētā tirgū netirgots procentu likmes nākotnes līgums** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FRAS** **RTS2#16 = INTR** **vai** **Regulētā tirgū tirgotam procentu likmes nākotnes līgumam piesaistīts regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums**	procentu likmes regulētā tirgū tirgota nākotnes līguma apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS2#24) – pamatā esoša procentu likme **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#25) – pamatā esošas procentu likmes termiņš **3. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks regulētā tirgū tirgota nākotnes līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 2. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 3. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads, 4. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi, 5. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	500 000 000 EUR	10	ikreiz, kad par kādu apakšklasi tiek konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus attiecībā uz konkrētu laiku, kāds atlicis līdz termiņam, un par to apakšklasi, kuru definē saskaņā ar nākamo termiņu grupu, tiek konstatēts, ka tai nav likvīda tirgus, uzskata, ka pirmajam līgumam ar vistālāko termiņu (*back month*) ir likvīds tirgus divas nedēļas līdz līguma ar vistuvāko termiņu (*front month*) beigām

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
RTS2#3 = DERV **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = IFUT** **vai** **Regulētā tirgū tirgotam procentu likmes nākotnes līgumam piesaistīts regulētā tirgū netirgots procentu likmes nākotnes līgums** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FRAS** **RTS2#16 = IFUT**				
Procentu likmes iespējas līgumi **/Regulētā tirgū tirgotam procentu likmes nākotnes līgumam piesaistīts iespējas līgums/regulētā tirgū netirgots procentu likmes nākotnes līgums** **/Procentu likmes iespēju līgumam piesaistīts iespējas līgums**	procentu likmes iespējas līguma apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS2#24) – pamatā esoša procentu likme **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#25) – pamatā esošas procentu likmes termiņš **3. segmentācijas kritērijs (RTS2#8)** – līdz termiņam atlikušais laiks iespējas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši	500 000 000 EUR	10	

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
/Regulētā tirgū tirgotam procentu likmes nākotnes līgumam piesaistīti divi secīgi iespējas līgumi /regulētā tirgū netirgots procentu likmes nākotnes līgums **Regulētā tirgū tirgotam procentu likmes nākotnes līgumam piesaistīts iespējas līgums/regulētā tirgū netirgots procentu likmes nākotnes līgums//"Procentu likmes iespējas līgumam piesaistīts iespējas līgums** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = IFUT** **vai** **Procentu likmes iespējas līgums// "Regulētā tirgū tirgotam procentu likmes nākotnes līgumam piesaistīti divi secīgi iespējas līgumi/ regulētā tirgū netirgots procentu likmes nākotnes līgums** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = INTR**	2. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 3. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads, 4. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi, 5. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi			

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
Mijmaiņas iespējas līgumi **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = SWPT**	mijmaiņas iespējas līguma apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS2#16) - pamatā esoša mijmaiņas līguma veids, kas definēts šādi: fiksēto procentu likmju vienas valūtas mijmaiņas līgums, fiksēto procentu likmju vienas valūtas mijmaiņas līgumam piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi **[RTS2#16 = XXSC]** fiksētās un mainīgās procentu likmes vienas valūtas mijmaiņas līgums, fiksētās un mainīgās procentu likmes vienas valūtas mijmaiņas līgumam piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi **[RTS2#16 = XFSC]** mainīgo procentu likmju vienas valūtas mijmaiņas līgums, mainīgo procentu likmju vienas valūtas mijmaiņas līgumam piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi **[RTS2#16 = FFSC]** inflācijai piesaistīts vienas valūtas mijmaiņas līgums, inflācijai piesaistītam vienas valūtas mijmaiņas līgumam piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi **[RTS2#16 = IFSC]** uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (*OIS*) vienas valūtas mijmaiņas līgums, *OIS* vienas valūtas mijmaiņas līgumam piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi **[RTS2#16 = OSSC]** fiksēto procentu likmju vairāku valūtu mijmaiņas līgums, fiksēto procentu likmju vairāku valūtu mijmaiņas līgumam piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi **[RTS2#16 = XXMC]**	500 000 000 EUR	10	

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
	fiksētas un mainīgas procentu likmes vairāku valūtu mijmaiņas līgums, fiksētas un mainīgas procentu likmes vairāku valūtu mijmaiņas līgumam piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi [**RTS2#16 = XFMC**] mainīgas procentu likmes vairāku valūtu mijmaiņas līgums, mainīgas procentu likmes vairāku valūtu mijmaiņas līgumam piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi [**RTS2#16 = FFMC**] inflācijai piesaistīts vairāku valūtu mijmaiņas līgums, inflācijai piesaistītam vairāku valūtu mijmaiņas līgumam piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi [**RTS2#16 = IFMC**] *OIS* vairāku valūtu mijmaiņas līgums, *OIS* vairāku valūtu mijmaiņas līgumam piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi [**RTS2#16 = OSMC**] **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#20) – nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta iespējas līguma nosacītā summa **3. segmentācijas kritērijs** (RTS2#22 vai RTS2#23) – inflācijas indekss, ja pamatā esošā mijmaiņas līguma veids ir vai nu inflācijai piesaistīts vienas valūtas mijmaiņas līgums, vai inflācijai piesaistīts vairāku valūtu mijmaiņas līgums **4. segmentācijas kritērijs** (RTS2#21) – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši			

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
	3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 4. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads, 5. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi, 6. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi **5. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks iespējas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: **1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši **2. termiņu grupa:** 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads **3. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi **4. termiņu grupa:** 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 5 gadi **5. termiņu grupa:** 5 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 10 gadi **6. termiņu grupa:** ilgāk par 10 gadiem			

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
fiksētās un mainīgās procentu likmes "vairāku valūtu mijmaiņas līgumi" vai "starpvalūtu mijmaiņas līgumi" un fiksētās un mainīgās procentu likmes "vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem" vai "starpvalūtu mijmaiņas līgumiem" piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi/iespējas līgumi mijmaiņas līgumam, kurā divas puses apmainās ar naudas plūsmām, kas denominētas dažādās valūtās, un kurā viena posma naudas plūsmas nosaka saskaņā ar fiksēto procentu likmi, un otra posma naudas plūsmas nosaka saskaņā ar mainīgo procentu likmi, piesaistīts mijmaiņas līgums vai regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums/iespējas līgums **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP vai FONS, vai FWOS, vai OPTS RTS2#16 = XFMC	fiksētās un mainīgās procentu likmes vairāku valūtu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#13 un RTS23#42) – nosacīto valūtu pāris ir definēts kā to abu valūtu kombinācija, kurās ir denominēti mijmaiņas līguma abi posmi **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < termiņš ≤ 1 mēnesis, 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < termiņš ≤ 3 mēneši, 3. termiņu grupa: 3 mēneši < termiņš ≤ 6 mēneši, 4. termiņu grupa: 6 mēneši < termiņš ≤ 1 gads, 5. termiņu grupa: 1 gads < termiņš ≤ 2 gadi, 6. termiņu grupa: 2 gadi < termiņš ≤ 3 gadi … m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
Mainīgo procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un mainīgo procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem” piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi/iespējas līgumi mijmaiņas līgumam, kurā divas puses apmainās ar naudas plūsmām, kas denominētas dažādās valūtās, un kurā abu posmu naudas plūsmas nosaka saskaņā ar mainīgām procentu likmēm, piesaistīts mijmaiņas līgums vai regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums/iespējas līgums RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP vai FONS vai FWOS vai OPTS RTS2#16 = FFMC	mainīgo procentu likmju vairāku valūtu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#13 un RTS23#42) – nosacīto valūtu pāris ir definēts kā to abu valūtu kombinācija, kurās ir denominēti mijmaiņas līguma abi posmi **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < termiņš ≤ 1 mēnesis, 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < termiņš ≤ 3 mēneši, 3. termiņu grupa: 3 mēneši < termiņš ≤ 6 mēneši, 4. termiņu grupa: 6 mēneši < termiņš ≤ 1 gads, 5. termiņu grupa: 1 gads < termiņš ≤ 2 gadi, 6. termiņu grupa: 2 gadi < termiņš ≤ 3 gadi … m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
Fiksēto procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un fiksēto procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem” piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi/iespējas līgumi mijmaiņas līgumam, kurā divas puses apmainās ar naudas plūsmām, kas denominētas dažādās valūtās, un kurā abu posmu naudas plūsmas nosaka saskaņā ar fiksētām procentu likmēm, piesaistīts mijmaiņas līgums vai regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums/iespējas līgums RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP vai FONS, vai FWOS, vai OPTS RTS2#16 = XXMC	fiksēto procentu likmju vairāku valūtu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#13 un RTS23#42) – nosacīto valūtu pāris ir definēts kā to abu valūtu kombinācija, kurās ir denominēti mijmaiņas līguma abi posmi **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 4. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads, 5. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi, 6. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
Uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (*OIS*) "vairāku valūtu mijmaiņas līgumi" vai "starpvalūtu mijmaiņas līgumi" un uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (*OIS*) "vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem" vai "starpvalūtu mijmaiņas līgumiem" piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi/iespējas līgumi mijmaiņas līgumam, kurā divas puses apmainās ar naudas plūsmām, kas denominētas dažādās valūtās, un kurā vismaz viena posma naudas plūsmas nosaka atbilstīgi uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (*OIS*) likmei, piesaistīts mijmaiņas līgums vai regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums/iespējas līgums RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP vai FONS, vai FWOS, vai OPTS RTS2#16 = OSMC	uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (*OIS*) vairāku valūtu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#13 un RTS23#42) – nosacīto valūtu pāris ir definēts kā to abu valūtu kombinācija, kurās ir denominēti mijmaiņas līguma abi posmi **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 4. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads, 5. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi, 6. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
Inflācijai piesaistītu "vairāku valūtu mijmaiņas līgumi" vai "starpvalūtu mijmaiņas līgumi" un inflācijai piesaistītiem "vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem" vai "starpvalūtu mijmaiņas līgumiem" piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi/iespējas līgumi mijmaiņas līgumam, kurā divas puses apmainās ar naudas plūsmām, kas denominētas dažādās valūtās, un kurā vismaz viena posma naudas plūsmas nosaka saskaņā ar inflācijas likmi, piesaistīts mijmaiņas līgums vai regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums/iespējas līgums **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP vai FONS, vai FWOS, vai OPTS RTS2#16 = IFMC	inflācijai piesaistītu vairāku valūtu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#13 un RTS23#42) – nosacīto valūtu pāris ir definēts kā to abu valūtu kombinācija, kurās ir denominēti mijmaiņas līguma abi posmi **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 4. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads, 5. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi, 6. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
Fiksētās un mainīgās procentu likmes "vienas valūtas mijmaiņas līgumi" un fiksētās un mainīgās procentu likmes "vienas valūtas mijmaiņas līgumiem" piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi/iespējas līgumi mijmaiņas līgumam, kurā divas puses apmainās ar naudas plūsmām, kas denominētas vienā un tajā pašā valūtā, un kurā vismaz vienu posmu nosaka saskaņā ar fiksēto procentu likmi, piesaistīts mijmaiņas līgums vai regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums/iespējas līgums **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP vai FONS, vai FWOS, vai OPTS RTS2#16 = XFSC	fiksētās un mainīgās procentu likmes vienas valūtas apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#13) – nosacītā valūta, kurā ir denominēti mijmaiņas līguma abi posmi **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 4. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads, 5. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi, 6. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
Mainīgo procentu likmju “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un mainīgo procentu likmju “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem” piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi/iespējas līgumi mijmaiņas līgumam, kurā divas puses apmainās ar naudas plūsmām, kas denominētas vienā un tajā pašā valūtā, un kurā abu posmu naudas plūsmas nosaka saskaņā ar mainīgām procentu likmēm, piesaistīts mijmaiņas līgums vai regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums/iespējas līgums RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP vai FONS, vai FWOS, vai OPTS RTS2#16 = FFSC	mainīgo procentu likmju vienas valūtas apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#13) – nosacītā valūta, kurā ir denominēti mijmaiņas līguma abi posmi **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 4. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads, 5. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi, 6. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
Fiksēto procentu likmju "vienas valūtas mijmaiņas līgumi" un fiksēto procentu likmju "vienas valūtas mijmaiņas līgumiem" piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi/iespējas līgumi mijmaiņas līgumam, kurā divas puses apmainās ar naudas plūsmām, kas denominētas vienā un tajā pašā valūtā, un kurā abu posmu naudas plūsmas nosaka saskaņā ar fiksētām procentu likmēm, piesaistīts mijmaiņas līgums vai regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums/ iespējas līgums RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP vai FONS, vai FWOS, vai OPTS RTS2#16 = XXSC	fiksēto procentu likmju vienas valūtas apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#13) – nosacītā valūta, kurā ir denominēti mijmaiņas līguma abi posmi **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 4. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads, 5. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi, 6. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
Uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (*OIS*) "vienas valūtas mijmaiņas līgumi" un uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (*OIS*) "vienas valūtas mijmaiņas līgumiem" piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi/iespējas līgumi mijmaiņas līgumam, kurā divas puses apmainās ar naudas plūsmām, kas denominētas vienā un tajā pašā valūtā, un kurā vismaz viena posma naudas plūsmas nosaka atbilstīgi uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (*OIS*) likmei, piesaistīts mijmaiņas līgums vai regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums/iespējas līgums **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP vai FONS, vai FWOS, vai OPTS RTS2#16 = OSSC	uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (*OIS*) vienas valūtas apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#13) – nosacītā valūta, kurā ir denominēti mijmaiņas līguma abi posmi **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 4. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads, 5. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi, 6. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām. Apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs**
Inflācijai piesaistīti "vienas valūtas mijmaiņas līgumi" un inflācijai piesaistītiem "vienas valūtas mijmaiņas līgumiem" piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi/iespējas līgumi mijmaiņas līgumam, kurā divas puses apmainās ar naudas plūsmām, kas denominētas vienā un tajā pašā valūtā, un kurā vismaz vienu posmu nosaka pēc inflācijas likmes, piesaistīts mijmaiņas līgums vai regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums/iespējas līgums **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP vai FONS, vai FWOS, vai OPTS RTS2#16 = IFSC	inflācijai piesaistītas vienas valūtas apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#13) – nosacītā valūta, kurā ir denominēti mijmaiņas līguma abi posmi **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 4. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads, 5. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi, 6. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti	
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi**
Citi procentu likmju atvasinātie instrumenti procentu likmju atvasinātais instruments, kas neietilpst nevienā no iepriekšminētajām aktīvu apakšklasēm **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = OTHR	jebkurš cits procentu likmju atvasinātais instruments, par kuru uzskata, ka tam nav likvīda tirgus

▼M4

5.2. tabula

Procentu likmju atvasinātie instrumenti – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvīds tirgus

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti									
Aktīvu apakšklase	**Procentūles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus**								
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	***LIS* pirmstirdzniecība**		***SSTI* pēctirdzniecība**			***LIS* pēctirdzniecība**		
		Tirdzniecība – procentīle	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**
Regulētā tirgū tirgoti obligāciju nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti obligāciju nākotnes līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	5 000 000 EUR	80.	60.	20 000 000 EUR	90.	70.	25 000 000 EUR
Obligācijas iespējas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	5 000 000 EUR	80.	60.	20 000 000 EUR	90.	70.	25 000 000 EUR
Regulētā tirgū tirgoti procentu likmes (*IR*) nākotnes līgumi un regulētā tirgū netirgoti procentu likmes nākotnes līgumi (*FRA*)	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	10 000 000 EUR	80.	60.	20 000 000 EUR	90.	70.	25 000 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti									
Aktīvu apakšklase	**Procentūles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus**								
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	***LIS* pirmstirdzniecība**		***SSTI* pēctirdzniecība**			***LIS* pēctirdzniecība**		
		Tirdzniecība – procentīle	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**
IR iespējas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	10 000 000 EUR	80.	60.	20 000 000 EUR	90.	70.	25 000 000 EUR
Mijmaiņas iespējas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	5 000 000 EUR	80.	60.	9 000 000 EUR	90.	70.	10 000 000 EUR
Fiksētās un mainīgās procentu likmes "vairāku valūtu mijmaiņas līgumi" vai "starpvalūtu mijmaiņas līgumi" un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fiksētās un mainīgās procentu likmes "vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem" vai "starpvalūtu mijmaiņas līgumiem"	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	5 000 000 EUR	80.	60.	9 000 000 EUR	90.	70.	10 000 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti									
Aktīvu apakšklase	**Procentūles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus**								
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	***LIS* pirmstirdzniecība**		***SSTI* pēctirdzniecība**			***LIS* pēctirdzniecība**		
		Tirdzniecība – procentīle	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**
Mainīgo procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par mainīgo procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem”	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	5 000 000 EUR	80.	60.	9 000 000 EUR	90.	70.	10 000 000 EUR
Fiksēto procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fiksēto procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem”	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	5 000 000 EUR	80.	60.	9 000 000 EUR	90.	70.	10 000 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti									
Aktīvu apakšklase	**Procentūles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus**								
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	***LIS* pirmstirdzniecība**		***SSTI* pēctirdzniecība**			***LIS* pēctirdzniecība**		
		Tirdzniecība – procentīle	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**
Uz nakti izsniegto kredītu indeksa mijmaiņas darījumu (*OIS*) "vairāku valūtu mijmaiņas līgumi" vai "starpvalūtu mijmaiņas līgumi" un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par uz nakti izsniegto kredītu indeksa mijmaiņas darījumu (*OIS*) "vienas valūtas mijmaiņas līgumiem" vai "starpvalūtu mijmaiņas līgumiem"	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	5 000 000 EUR	80.	60.	9 000 000 EUR	90.	70.	10 000 000 EUR
Inflācijai piesaistītu "vairāku valūtu mijmaiņas līgumi" vai "starpvalūtu mijmaiņas līgumi" un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par inflācijai piesaistītiem "vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem" vai "starpvalūtu mijmaiņas līgumiem"	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	5 000 000 EUR	80.	60.	9 000 000 EUR	90.	70.	10 000 000 EUR
Fiksētās un mainīgās procentu likmes "vienas valūtas mijmaiņas līgumi" un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fiksētās un mainīgās procentu likmes"vienas valūtas mijmaiņas līgumiem"	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	5 000 000 EUR	80.	60.	9 000 000 EUR	90.	70.	10 000 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti									
Aktīvu apakšklase	**Procentūles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus**								
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	***LIS* pirmstirdzniecība**		***SSTI* pēctirdzniecība**			***LIS* pēctirdzniecība**		
		Tirdzniecība – procentīle	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**
Mainīgo procentu likmju “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par mainīgo procentu likmju “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem”	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	5 000 000 EUR	80.	60.	9 000 000 EUR	90.	70.	10 000 000 EUR
Fiksēto procentu likmju “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fiksēto procentu likmju “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem”	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	5 000 000 EUR	80.	60.	9 000 000 EUR	90.	70.	10 000 000 EUR
Uz nakti izsniegto kredītu indeksa mijmaiņas darījumu (*OIS*) “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par uz nakti izsniegto kredītu indeksa mijmaiņas darījumu (*OIS*) “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem”	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	5 000 000 EUR	80.	60.	9 000 000 EUR	90.	70.	10 000 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti									
Aktīvu apakšklase	**Procentūles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus**								
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	***LIS* pirmstirdzniecība**		***SSTI* pēctirdzniecība**			***LIS* pēctirdzniecība**		
		Tirdzniecība – procentīle	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**
Inflācijai piesaistīti "vienas valūtas mijmaiņas līgumi" un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par inflācijai piesaistītiem "vienas valūtas mijmaiņas līgumiem"	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	5 000 000 EUR	80.	60.	9 000 000 EUR	90.	70.	10 000 000 EUR

5.3. tabula

Procentu likmes atvasinātie instrumenti –pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai nav likvīda tirgus**		
	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
	Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
Regulētā tirgū tirgoti obligāciju nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti obligāciju nākotnes līgumi	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Obligācijas iespējas līgumi	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Regulētā tirgū tirgoti procentu likmes (*IR*) nākotnes līgumi un regulētā tirgū netirgoti procentu likmes nākotnes līgumi (*FRA*)	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai nav likvīda tirgus**		
	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
	Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
IR iespējas līgumi	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Mijmaiņas iespējas līgumi	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Fiksētās un mainīgās procentu likmes “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fiksētās un mainīgās procentu likmes “vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem”	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Mainīgo procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par mainīgo procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem”	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Fiksēto procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fiksēto procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem”	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Uz nakti izsniegto kredītu indeksa mijmaiņas darījumu (*OIS*) “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par uz nakti izsniegto kredītu indeksa mijmaiņas darījumu (*OIS*) “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem”	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Inflācijai piesaistītu “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par inflācijai piesaistītiem “vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem”	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Fiksētās un mainīgās procentu likmes “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fiksētās un mainīgās procentu likmes“vienas valūtas mijmaiņas līgumiem”	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai nav likvīda tirgus**		
	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
	Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
Mainīgo procentu likmju "vienas valūtas mijmaiņas līgumi" un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par mainīgo procentu likmju "vienas valūtas mijmaiņas līgumiem"	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Fiksēto procentu likmju "vienas valūtas mijmaiņas līgumi" un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fiksēto procentu likmju "vienas valūtas mijmaiņas līgumiem"	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Uz nakti izsniegto kredītu indeksa mijmaiņas darījumu (*OIS*) "vienas valūtas mijmaiņas līgumi" un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par uz nakti izsniegto kredītu indeksa mijmaiņas darījumu (*OIS*) "vienas valūtas mijmaiņas līgumiem"	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Inflācijai piesaistīti "vienas valūtas mijmaiņas līgumi" un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par inflācijai piesaistītiem "vienas valūtas mijmaiņas līgumiem"	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Citi procentu likmju atvasinātie instrumenti	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR

▼B

6. **Kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti**

▼M3

6.1. tabula

Kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti – klases, kurām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti
jebkurš līgums, kas definēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma C iedaļas 4. punktā un ir saistīts ar:
a) vienu vai vairākām akcijām, depozitārajiem sertifikātiem, biržā tirgotiem fondiem, sertifikātiem, citiem līdzīgiem finanšu instrumentiem, naudas plūsmām vai citiem produktiem, kas ir saistīti ar vienas vai vairāku akciju, depozitāro sertifikātu, biržā tirgotu fondu, sertifikātu vai citu līdzīgu finanšu instrumentu darbības rezultātiem;
b) akciju, depozitāro sertifikātu, biržā tirgotu fondu, sertifikātu, citu līdzīgu finanšu instrumentu, naudas plūsmu vai citu produktu, kas ir saistīti ar vienas vai vairāku akciju, depozitāro sertifikātu, biržā tirgotu fondu, sertifikātu vai citu līdzīgu finanšu instrumentu darbības rezultātiem, indeksu;

▼M3

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti	
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi**
Akciju indeksa iespējas līgumi iespējas līgums, kura pamatā esošais instruments ir indekss, ko veido akcijas RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = STIX RTS23#26 vai, ja nav, RTS23#28	tiek uzskatīts, ka visiem indeksa iespējas līgumiem ir likvīds tirgus
Regulētā tirgū tirgoti akciju indeksa nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti akciju indeksa nākotnes līgumi regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums, kura pamatā esošais instruments ir indekss, ko veido akcijas RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR vai FORW RTS2#27 = STIX RTS23#26 vai, ja nav, RTS23#28	tiek uzskatīts, ka visiem regulētā un neregulētā tirgū tirgotiem indeksa nākotnes līgumiem ir likvīds tirgus
Akciju iespējas līgumi iespējas līgums, kura pamatā esošais instruments ir akcija vai akciju grozs, kas tapis korporatīvas darbības rezultātā RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = SHRS RTS23#26 vai, ja nav, RTS23#28	tiek uzskatīts, ka visiem akciju iespējas līgumiem ir likvīds tirgus

▼M3

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti	
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi**
Regulētā tirgū tirgoti akciju nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti akciju nākotnes līgumi regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums, kura pamatā esošais instruments ir akcija vai akciju grozs, kas tapis korporatīvas darbības rezultātā RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR vai FORW RTS2#27 = SHRS RTS23#26 vai, ja nav, RTS23#28	tiek uzskatīts, ka visiem regulētā un neregulētā tirgū tirgotiem akciju nākotnes līgumiem ir likvīds tirgus
Akciju dividenžu iespējas līgumi konkrētas akcijas dividendei piesaistīts iespējas līgums RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI’ RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = DVSE RTS23#26 vai, ja nav, RTS23#28	tiek uzskatīts, ka visiem akciju dividenžu iespējas līgumiem ir likvīds tirgus
Akciju dividenžu regulētā tirgū tirgotie nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgotie nākotnes līgumi konkrētas akcijas dividendei piesaistīts regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI’ RTS2#5 = FUTR vai FORW RTS2#27 = DVSE RTS23#26 vai, ja nav, RTS23#28	tiek uzskatīts, ka visiem akciju dividenžu regulētā tirgū tirgotiem nākotnes līgumiem/ regulētā tirgū netirgotiem nākotnes līgumiem ir likvīds tirgus

▼M3

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti	
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi**
Dividenžu indeksa iespējas līgumi indeksam piesaistīts iespējas līgums, ko veido dividendes vairāk nekā vienai akcijai RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = DIVI RTS23#26 vai, ja nav, RTS23#28	tiek uzskatīts, ka visiem dividenžu indeksa iespējas līgumiem ir likvīds tirgus
Dividenžu indeksa regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi indeksam, ko veido dividendes vairāk nekā vienai akcijai, piesaistīts regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = FUTR vai FORW RTS2#27 = DIVI RTS23#26 vai, ja nav, RTS23#28	tiek uzskatīts, ka visiem dividenžu indeksa regulētā tirgū tirgotiem nākotnes līgumiem/ regulētā tirgū netirgotiem nākotnes līgumiem ir likvīds tirgus
Svārstīguma indeksa iespējas līgumi iespējas līgums, kura pamatā esošais instruments ir svārstīguma indekss, kas tiek definēts kā indekss, kas ir saistīts ar konkrēta pamatā esoša kapitāla vērtspapīru instrumentu indeksa svārstīgumu RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = VOLI RTS23#26 vai, ja nav, RTS23#28	tiek uzskatīts, ka visiem svārstīguma indeksa iespējas līgumiem ir likvīds tirgus

▼M3

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti	
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi**
Svārstīguma indeksa regulētā tirgū tirgotie nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgotie nākotnes līgumi regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums, kura pamatā esošais instruments ir svārstīguma indekss, kas tiek definēts kā indekss, kas ir saistīts ar konkrēta pamatā esoša kapitāla vērtspapīru instrumentu indeksa svārstīgumu RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = FUTR vai FORW RTS2#27 = VOLI RTS23#26 vai, ja nav, RTS23#28	tiek uzskatīts, ka visiem svārstīguma indeksa regulētā tirgū tirgotiem nākotnes līgumiem/regulētā tirgū netirgotiem nākotnes līgumiem ir likvīds tirgus
Biržā tirgotu fondu iespējas līgumi iespējas līgums, kura pamatā esošais instruments ir biržā tirgots fonds RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = ETFS RTS23#26 vai, ja nav, RTS23#28	tiek uzskatīts, ka visiem biržā tirgotu fondu iespējas līgumiem ir likvīds tirgus
Biržā tirgotu fondu regulētā tirgū tirgotie nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgotie nākotnes līgumi regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums, kura pamatā esošais instruments ir biržā tirgots fonds RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = FUTR vai FORW RTS2#27 = ETFS RTS23#26 vai, ja nav, RTS23#28	tiek uzskatīts, ka visiem biržā tirgotu fondu regulētā tirgū tirgotiem nākotnes līgumiem/regulētā tirgū netirgotiem nākotnes līgumiem ir likvīds tirgus

▼M3

<table>
<tr><td colspan="4">Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Aktīvu apakšklase</td><td rowspan="2">Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk</td><td colspan="2">Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām</td></tr>
<tr><td>Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA)
[1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]</td><td>Dienas vidējais darījumu skaits
[2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]</td></tr>
<tr><td>Mijmaiņas līgumi
RTS2#3 = DERV
RTS2#4 = EQUI’
RTS2#5 = SWAP</td><td>mijmaiņas līguma apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem:
1. segmentācijas kritērijs (RTS2#27) – pamatā esoša instrumenta veids: ar vienu parādnieku saistīts līgums, indekss, grozs
2. segmentācijas kritērijs (RTS23#26 vai, ja nav, RTS23#28) – pamatā esošais ar vienu parādnieku saistīts līgums, indekss, grozs
3. segmentācijas kritērijs (RTS2#28) – parametrs: cenas ieņēmumu darbības bāzes parametrs, ieņēmumu no dividendēm parametrs, ieņēmumu dispersijas parametrs, ieņēmumu svārstīguma parametrs
4. segmentācijas kritērijs (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi:
<table>
<tr><td>Cenas ieņēmumu darbības bāzes parametrs</td><td>Ieņēmumu dispersijas/svārstīguma parametrs</td><td>Ieņēmumu no dividendēm parametrs</td></tr>
<tr><td>1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis</td><td>1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši</td><td>1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads</td></tr>
<tr><td>2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši</td><td>2. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši</td><td>2. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi</td></tr>
<tr><td>3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši</td><td>3. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads</td><td>3. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi</td></tr>
<tr><td>4. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads</td><td>4. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi</td><td>…</td></tr>
</table></td><td>50 000 000 EUR</td><td></td></tr>
</table>

▼M3

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti					
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**			**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām**	
				Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
	5. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	**5. termiņu grupa:** 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi	**m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi		
	6. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi	…			
	…	**m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi			
	m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi				
Portfeļa mijmaiņas līgumi RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = PSWP	portfeļa mijmaiņas līgumu apakšklasi veido īpaša kombinācija: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS2#27) – pamatā esoša instrumenta veids: ar vienu parādnieku saistīts līgums, indekss, grozs **2. segmentācijas kritērijs** (RTS23#26 vai, ja nav, RTS23#28) – pamatā esošais ar vienu parādnieku saistīts līgums, indekss, grozs **3. segmentācijas kritērijs** (RTS2#28) – parametrs: cenas ieņēmumu darbības bāzes parametrs, ieņēmumu no dividendēm parametrs, ieņēmumu dispersijas parametrs, ieņēmumu svārstīguma parametrs **4. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks portfeļa mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: **1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis **2. termiņu grupa:** 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši, **3. termiņu grupa:** 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši, **4. termiņu grupa:** 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads, **5. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi, **6. termiņu grupa:** 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … **m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi			50 000 000 EUR	15

▼M3

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti	
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi**
Citi kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti kapitāla vērtspapīru atvasinātais instruments, kas nepieder nevienai no iepriekšminētajām aktīvu apakšklasēm RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OTHR’	par visiem pārējiem kapitāla vērtspapīru atvasinātajiem instrumentiem uzskata, ka tiem nav likvīda tirgus

▼M4

6.2. tabula

Kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti						
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības, katru aktīvu apakšklasi turpmāk sadala apakšklasēs, kā definēts turpmāk**	**Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības**	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības vērtības, kas noteiktas apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, pamatojoties uz dienas vidējās nosacītās summas (*ADNA*) diapazonu, kuram pieder konkrētā apakšklase**			
			Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*)	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
				Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
Akciju indeksa iespējas līgumi	akciju indeksa iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs –** pamatā esošu akciju indekss	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< 100 milj. EUR *ADNA*	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 milj. EUR ≤ *ADNA* < 200 milj. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 milj. EUR ≤ *ADNA* < 600 milj. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 milj. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti						
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības, katru aktīvu apakšklasi turpmāk sadala apakšklasēs, kā definēts turpmāk**	**Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības**	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības vērtības, kas noteiktas apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, pamatojoties uz dienas vidējās nosacītās summas (*ADNA*) diapazonu, kuram pieder konkrētā apakšklase**			
			Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*)	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
				Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
Regulētā tirgū tirgotie akciju indeksa nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgotie akciju indeksa nākotnes līgumi	regulētā tirgū tirgoto akciju indeksa nākotnes līgumu / regulētā tirgū netirgoto akciju indeksa nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs –** pamatā esošu akciju indekss	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< 100 milj. EUR *ADNA*	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 milj. EUR ≤ *ADNA* < 1 mljrd. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mljrd. EUR ≤ *ADNA* < 3 mljrd. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mljrd. EUR ≤ *ADNA* < 5 mljrd. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 mljrd. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Akciju iespējas līgumi	akciju iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs –** pamatā esoša akcija	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< 5 milj. EUR *ADNA*	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 milj. EUR ≤ *ADNA* < 10 milj. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 milj. EUR ≤ *ADNA* < 20 milj. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 milj. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti						
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības, katru aktīvu apakšklasi turpmāk sadala apakšklasēs, kā definēts turpmāk**	**Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības**	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības vērtības, kas noteiktas apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, pamatojoties uz dienas vidējās nosacītās summas (*ADNA*) diapazonu, kuram pieder konkrētā apakšklase**			
			Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*)	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
				Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
Regulētā tirgū tirgotie akciju nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgotie akciju nākotnes līgumi	regulētā tirgū tirgoto akciju nākotnes līgumu / regulētā tirgū netirgoto akciju nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs –** pamatā esoša akcija	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< 5 milj. EUR *ADNA*	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 milj. EUR ≤ *ADNA* < 10 milj. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 milj. EUR ≤ *ADNA* < 20 milj. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 milj. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
Akciju dividenžu iespējas līgumi	akciju dividenžu iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs –** pamatā esoša akcija, kas piešķir tiesības uz dividendēm	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< 5 milj. EUR *ADNA*	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR
			5 milj. EUR ≤ *ADNA* < 10 milj. EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR
			10 milj. EUR ≤ *ADNA* < 20 milj. EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			ADNA ≥ 20 milj. EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti						
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības, katru aktīvu apakšklasi turpmāk sadala apakšklasēs, kā definēts turpmāk**	**Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības**	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības vērtības, kas noteiktas apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, pamatojoties uz dienas vidējās nosacītās summas (*ADNA*) diapazonu, kuram pieder konkrētā apakšklase**			
			Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*)	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
				Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
Regulētā tirgū tirgotie akciju dividenžu nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgotie akciju dividenžu nākotnes līgumi	regulētā tirgū tirgoto akciju dividenžu nākotnes līgumu / regulētā tirgū netirgoto akciju dividenžu nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs –** pamatā esoša akcija, kas piešķir tiesības uz dividendēm	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< 5 milj. EUR *ADNA*	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR
			5 milj. EUR ≤ *ADNA* < 10 milj. EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR
			10 milj. EUR ≤ *ADNA* < 20 milj. EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			ADNA ≥ 20 milj. EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR
Dividenžu indeksa iespējas līgumi	dividenžu indeksa iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs –** pamatā esošu dividenžu indekss	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< 100 milj. EUR *ADNA*	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 milj. EUR ≤ *ADNA* < 200 milj. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 milj. EUR ≤ *ADNA* < 600 milj. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 milj. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti						
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības, katru aktīvu apakšklasi turpmāk sadala apakšklasēs, kā definēts turpmāk**	**Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības**	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības vērtības, kas noteiktas apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, pamatojoties uz dienas vidējās nosacītās summas (*ADNA*) diapazonu, kuram pieder konkrētā apakšklase**			
			Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*)	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
				Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
Regulētā tirgū tirgotie dividenžu indeksa nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgotie dividenžu indeksa nākotnes līgumi	regulētā tirgū tirgoto dividenžu indeksa nākotnes līgumu /regulētā tirgū netirgoto dividenžu indeksa nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs –** pamatā esošu dividenžu indekss	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< 100 milj. EUR *ADNA*	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 milj. EUR ≤ *ADNA* < 1 mljrd. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mljrd. EUR ≤ *ADNA* < 3 mljrd. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mljrd. EUR ≤ *ADNA* < 5 mljrd. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 mljrd. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Svārstīguma indeksa iespējas līgumi	svārstīguma indeksa iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs –** pamatā esošs svārstīguma indekss	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< 100 milj. EUR *ADNA*	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 milj. EUR ≤ *ADNA* < 200 milj. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 milj. EUR ≤ *ADNA* < 600 milj. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 milj. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti						
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības, katru aktīvu apakšklasi turpmāk sadala apakšklasēs, kā definēts turpmāk**	**Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības**	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības vērtības, kas noteiktas apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, pamatojoties uz dienas vidējās nosacītās summas (*ADNA*) diapazonu, kuram pieder konkrētā apakšklase**			
			Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*)	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
				Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
Regulētā tirgū tirgotie svārstīguma indeksa nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgotie svārstīguma indeksa nākotnes līgumi	regulētā tirgū tirgoto svārstīguma indeksa nākotnes līgumu / regulētā tirgū netirgoto nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs –** pamatā esošs svārstīguma indekss	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< 100 milj. EUR *ADNA*	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 milj. EUR ≤ *ADNA* < 1 mljrd. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mljrd. EUR ≤ *ADNA* < 3 mljrd. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mljrd. EUR ≤ *ADNA* < 5 mljrd. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 mljrd. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Biržā tirgotu fondu iespējas līgumi	Biržā tirgotu fondu iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs –** pamatā esošs biržā tirgots fonds	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< 5 milj. EUR *ADNA*	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 milj. EUR ≤ *ADNA* < 10 milj. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 milj. EUR ≤ *ADNA* < 20 milj. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 milj. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti						
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības, katru aktīvu apakšklasi turpmāk sadala apakšklasēs, kā definēts turpmāk**	**Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības**	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības vērtības, kas noteiktas apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, pamatojoties uz dienas vidējās nosacītās summas (*ADNA*) diapazonu, kuram pieder konkrētā apakšklase**			
			Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*)	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
				Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
Regulētā tirgū tirgotie biržā tirgotu fondu nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgotie biržā tirgotu fondu nākotnes līgumi	Regulētā tirgū tirgoto biržā tirgotu fondu nākotnes līgumu / regulētā tirgū netirgoto biržā tirgotu fondu nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs –** pamatā esošs biržā tirgots fonds	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< 5 milj. EUR *ADNA*	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 milj. EUR ≤ *ADNA* < 10 milj. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 milj. EUR ≤ *ADNA* < 20 milj. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 milj. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
Mijmaiņas līgumi	mijmaiņas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs –** pamatā esošais veids: ar vienu parādnieku saistīts līgums, indekss, grozs **2. segmentācijas kritērijs** – pamatā esošais ar vienu parādnieku saistīts līgums, indekss, grozs **3. segmentācijas kritērijs –** parametrs: cenas ieņēmumu darbības bāzes parametrs, ieņēmumu no dividendēm parametrs, ieņēmumu dispersijas parametrs, ieņēmumu svārstīguma parametrs **4. segmentācijas kritērijs** – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi:	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	50 milj. EUR ≤ *ADNA* < 100 milj. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 milj. EUR ≤ *ADNA* < 200 milj. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 200 milj. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti								
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības, katru aktīvu apakšklasi turpmāk sadala apakšklasēs, kā definēts turpmāk**			**Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības**	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības vērtības, kas noteiktas apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, pamatojoties uz dienas vidējās nosacītās summas (*ADNA*) diapazonu, kuram pieder konkrētā apakšklase**			
					Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*)	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
						Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
	Cenas ieņēmumu darbības bāzes parametrs	Ieņēmumu dispersijas/svārstīguma parametrs	Ieņēmumu no dividendēm parametrs					
	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis	**1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši	**1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads					
	2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši	**2. termiņu grupa:** 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši	**2. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi					
	3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši	**3. termiņu grupa:** 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	**3. termiņu grupa:** 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi					
	4. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	**4. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	...					

▼M4

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti								
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības, katru aktīvu apakšklasi turpmāk sadala apakšklasēs, kā definēts turpmāk**			**Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības**	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības vērtības, kas noteiktas apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, pamatojoties uz dienas vidējās nosacītās summas (*ADNA*) diapazonu, kuram pieder konkrētā apakšklase**			
					Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*)	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
						Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
	5. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	**5. termiņu grupa:** 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi	**m termiņu grupa:** *m* termiņu grupa: (*n*–1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ *n* gadi					
	6. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi	...						
	...	**m termiņu grupa:** *m* termiņu grupa: (*n*–1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ *n* gadi						
	m termiņu grupa: *m* termiņu grupa: (*n*–1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ *n* gadi							
Portfeļa mijmaiņas līgumi	portfeļa mijmaiņas līgumu apakšklasi veido īpaša kombinācija: **1. segmentācijas kritērijs –** pamatā esošais veids: ar vienu parādnieku saistīts līgums, indekss, grozs **2. segmentācijas kritērijs** – pamatā esošais ar vienu parādnieku saistīts līgums, indekss, grozs **3. segmentācijas kritērijs –** parametrs: cenas ieņēmumu darbības bāzes parametrs, ieņēmumu no dividendēm parametrs, ieņēmumu dispersijas parametrs, ieņēmumu svārstīguma parametrs **4. segmentācijas kritērijs** – līdz termiņam atlikušais laiks portfeļa mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi:			robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	50 milj. EUR ≤ *ADNA* < 100 milj. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
					100 milj. EUR ≤ *ADNA* < 200 milj. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
					ADNA ≥ 200 milj. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti						
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības, katru aktīvu apakšklasi turpmāk sadala apakšklasēs, kā definēts turpmāk**	**Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības**	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības vērtības, kas noteiktas apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, pamatojoties uz dienas vidējās nosacītās summas (*ADNA*) diapazonu, kuram pieder konkrētā apakšklase**			
			Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*)	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
				Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis **2. termiņu grupa:** 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši **3. termiņu grupa:** 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši **4. termiņu grupa:** 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads **5. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi **6. termiņu grupa:** 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi ... **m termiņu grupa:** *m* termiņu grupa: (*n*–1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ *n* gadi					

6.3. tabula

Kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus**		
	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
	Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
Mijmaiņas līgumi	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR
Portfeļa mijmaiņas līgumi	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR
Citi kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR

▼B

7. **Preču atvasinātie instrumenti**

▼M3

7.1. tabula

Preču atvasinātie instrumenti – klases, kurām nav likvīda tirgus

<table>
<tr><td colspan="4">Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Aktīvu apakšklase</td><td rowspan="2">Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk</td><td colspan="2">Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām robežvērtībām</td></tr>
<tr><td>Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA)
[1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]</td><td>Dienas vidējais darījumu skaits
[2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]</td></tr>
<tr><td>Regulētā tirgū tirgoti preču metālu nākotnes līgumi/ regulētā tirgū netirgoti preču metālu nākotnes līgumi
RTS2#3 = “DERV” un RTS2#4 = “COMM” un RTS23#35 = “METL” un [RTS2#5 = “FUTR” vai “FORW”]</td><td>regulētā tirgū tirgoto preču metālu nākotnes līgumu/regulētā tirgū netirgoto preču metālu nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem:
1. segmentācijas kritērijs (RTS23#36) – metāla veids: dārgmetāls, nedārgmetāls
2. segmentācijas kritērijs (RTS23#37) – pamatā esošais metāls
3. segmentācijas kritērijs (RTS2#15) – nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta regulētā tirgū tirgota nākotnes līguma/regulētā tirgū netirgota nākotnes līguma nosacītā summa
4. segmentācijas kritērijs (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks regulētā tirgū tirgota nākotnes līguma/ regulētā tirgū netirgota nākotnes līguma termiņu grupā ir definēts šādi:
<table><tr><th>Dārgmetāli</th><th>Nedārgmetāli</th></tr><tr><td>1. termiņu grupa:
0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši</td><td>1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads</td></tr><tr><td>2. termiņu grupa:
3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads</td><td>2. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi</td></tr><tr><td>3. termiņu grupa:
1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi</td><td>3. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi</td></tr></table></td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
</table>

▼M3

<table>
<tr><td colspan="4">Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Aktīvu apakšklase</td><td colspan="2" rowspan="2">Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk</td><td colspan="2">Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām robežvērtībām</td></tr>
<tr><td>Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA)
[1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]</td><td>Dienas vidējais darījumu skaits
[2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]</td></tr>
<tr><td></td><td>4. termiņu grupa:
2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi</td><td>…</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>…</td><td>m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>Metāla preču iespējas līgumi
RTS2#3 = “DERV” un RTS2#4 = “COMM” un RTS23#35 = “METL” un RTS2#5 = “OPTN”</td><td colspan="2">metāla preču iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem:
1. segmentācijas kritērijs (RTS23#36) – metāla veids: dārgmetāls, nedārgmetāls
2. segmentācijas kritērijs (RTS23#37) – pamatā esošais metāls
3. segmentācijas kritērijs (RTS2#15) – nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta iespējas līguma nosacītā summa
4. segmentācijas kritērijs (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks iespējas līguma termiņu grupā ir definēts šādi:</td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
<tr><td></td><td>Dārgmetāli</td><td>Nedārgmetāli</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>1. termiņu grupa:
0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši</td><td>1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>2. termiņu grupa:
3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads</td><td>2. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi</td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

<table>
<tr><td colspan="4">Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Aktīvu apakšklase</td><td colspan="2" rowspan="2">Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk</td><td colspan="2">Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām robežvērtībām</td></tr>
<tr><td>Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA)
[1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]</td><td>Dienas vidējais darījumu skaits
[2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]</td></tr>
<tr><td></td><td>3. termiņu grupa:
1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi</td><td>3. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi</td><td rowspan="4"></td><td rowspan="4"></td></tr>
<tr><td></td><td>4. termiņu grupa:
2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi</td><td>…</td></tr>
<tr><td></td><td>…</td><td>m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi</td></tr>
<tr><td></td><td>m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi</td><td></td></tr>
<tr><td>Metāla preču mijmaiņas līgumi
RTS2#3 = “DERV” un RTS2#4 = “COMM” un RTS23#35 = “METL” un RTS2#5 = “SWAP”</td><td colspan="2">metāla preču mijmaiņas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem:
1. segmentācijas kritērijs (RTS23#36) – metāla veids: dārgmetāls, nedārgmetāls
2. segmentācijas kritērijs (RTS23#37) – pamatā esošais metāls
3. segmentācijas kritērijs (RTS2#15) – nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta mijmaiņas līguma nosacītā summa
4. segmentācijas kritērijs (RTS23#34) – piegādes veids, kas definēts kā norēķins ar naudu, fiziskiem aktīviem vai pēc izvēles
5. segmentācijas kritērijs (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi:</td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
<tr><td></td><td>Dārgmetāli</td><td>Nedārgmetāli</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>1. termiņu grupa:
0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši</td><td>1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads</td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**		**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām robežvērtībām**	
			Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
	2. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	**2. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi		
	3. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	**3. termiņu grupa:** 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi		
	4. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi	…		
	…	**m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi		
	m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi			
Regulētā tirgū tirgoti energopreču nākotnes līgumi/ regulētā tirgū netirgoti energopreču nākotnes līgumi RTS2#3 = “DERV” un RTS2#4 = “COMM” un RTS23#35 = “METL” un [RTS2#5 = “FUTR” vai “FORW”]	regulētā tirgū tirgoto energopreču nākotnes līgumu/regulētā tirgū netirgoto energopreču nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#36) – enerģijas veids: nafta, naftas destilāti, ogles, naftas vieglās beigu frakcijas, dabasgāze, elektroenerģija, saistīti enerģētikas produkti **2. segmentācijas kritērijs** (RTS23#37) – pamatā esošā enerģija **3. segmentācijas kritērijs** (RTS2#15) – nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta regulētā tirgū tirgota nākotnes līguma/regulētā tirgū netirgota nākotnes līguma nosacītā summa **4. segmentācijas kritērijs** – [svītrots]		10 000 000 EUR	10

▼M3

<table>
<tr><td colspan="5">Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Aktīvu apakšklase</td><td colspan="3" rowspan="2">Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk</td><td colspan="2">Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām robežvērtībām</td></tr>
<tr><td>Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA)
[1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]</td><td>Dienas vidējais darījumu skaits
[2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="3">5. segmentācijas kritērijs (RTS2#14) – piegādes/naudas norēķinu vieta, ko piemēro visiem enerģijas veidiem
6. segmentācijas kritērijs (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks regulētā tirgū tirgota nākotnes līguma/regulētā tirgū netirgota nākotnes līguma termiņu grupā ir definēts šādi:</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Nafta/naftas destilāti/naftas vieglās beigu frakcijas</td><td>Ogles</td><td>Dabasgāze/elektroenerģija/saistīti enerģētikas produkti</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>1. termiņu grupa:
0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 4 mēneši</td><td>1. termiņu grupa:
0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši</td><td>1. termiņu grupa:
0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>2. termiņu grupa:
4 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 8 mēneši</td><td>2. termiņu grupa:
6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads</td><td>2. termiņu grupa:
1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>3. termiņu grupa:
8 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads</td><td>3. termiņu grupa:
1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi</td><td>3. termiņu grupa:
1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>4. termiņu grupa:
1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi</td><td>…</td><td>…</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>…</td><td>m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi</td><td>m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi</td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

<table>
<tr><th colspan="4">Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Aktīvu apakšklase</th><th rowspan="2">Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk</th><th colspan="2">Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām robežvērtībām</th></tr>
<tr><th>Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA)
[1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]</th><th>Dienas vidējais darījumu skaits
[2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]</th></tr>
<tr><td>Energopreču iespējas līgumi
RTS2#3 = “DERV” un RTS2#4 = “COMM” un RTS23#35 = “NRGY” un RTS2#5 = “OPTN”</td><td>energopreču iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem:
1. segmentācijas kritērijs (RTS23#36) – enerģijas veids: nafta, naftas destilāti, ogles, naftas vieglās beigu frakcijas, dabasgāze, elektroenerģija, saistīti enerģētikas produkti
2. segmentācijas kritērijs (RTS23#37) – pamatā esošā enerģija
3. segmentācijas kritērijs (RTS2#15) – nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta iespējas līguma nosacītā summa
4. segmentācijas kritērijs – [svītrots]
5. segmentācijas kritērijs (RTS2#14) – piegādes/naudas norēķinu vieta, ko piemēro visiem enerģijas veidiem
6. segmentācijas kritērijs (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks iespējas līguma termiņu grupā ir definēts šādi:
<table>
<tr><th>Nafta/naftas destilāti/naftas vieglās beigu frakcijas</th><th>Ogles</th><th>Dabasgāze/elektroenerģija/saistīti enerģētikas produkti</th></tr>
<tr><td>1. termiņu grupa:
0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 4 mēneši</td><td>1. termiņu grupa:
0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši</td><td>1. termiņu grupa:
0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis</td></tr>
<tr><td>2. termiņu grupa:
4 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 8 mēneši</td><td>2. termiņu grupa:
6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads</td><td>2. termiņu grupa:
1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads</td></tr>
</table></td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
</table>

▼M3

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti					
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**			**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām robežvērtībām**	
				Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
	3. termiņu grupa: 8 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	**3. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	**3. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi		
	4. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	…	…		
	…	**m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	**m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi		
	m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi				
Energopreču mijmaiņas līgumi RTS2#3 = “DERV” un RTS2#4 = “COMM” un RTS23#35 = “NRGY” un RTS2#5 = “SWAP”	energopreču mijmaiņas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#36) – enerģijas veids: nafta, naftas destilāti, ogles, naftas vieglās beigu frakcijas, dabasgāze, elektroenerģija, saistīti enerģētikas produkti **2. segmentācijas kritērijs** (RTS23#37) – pamatā esošā enerģija **3. segmentācijas kritērijs** (RTS2#15) – nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta mijmaiņas līguma nosacītā summa **4. segmentācijas kritērijs** (RTS23#34) – piegādes veids, kas definēts kā norēķins ar naudu, fiziskiem aktīviem vai pēc izvēles **5. segmentācijas kritērijs** – [svītrots] **6. segmentācijas kritērijs** (RTS2#14) – piegādes/naudas norēķinu vieta, ko piemēro visiem enerģijas veidiem **7. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi:			10 000 000 EUR	10

▼M3

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti					
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**			**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām robežvērtībām**	
				Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
	Nafta/naftas destilāti/naftas vieglās beigu frakcijas	**Ogles**	**Dabasgāze/elektroenerģija/saistīti enerģētikas produkti**		
	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 4 mēneši	**1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši	**1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis		
	2. termiņu grupa: 4 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 8 mēneši	**2. termiņu grupa:** 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	**2. termiņu grupa:** 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads		
	3. termiņu grupa: 8 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	**3. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	**3. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi		
	4. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	…	…		
	…	**m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	**m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi		
	m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi				
Regulētā tirgū tirgoti lauksaimniecības preču nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti lauksaimniecības preču nākotnes līgumi RTS2#3 = “DERV” un RTS2#4 = “COMM” un RTS23#35 = “AGRI” un [RTS2#5 = “FUTR” vai “FORW”]	regulētā tirgū tirgotu lauksaimniecības preču nākotnes līgumu/regulētā tirgū netirgotu lauksaimniecības preču nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#36 un RTS23#37) – pamatā esošā lauksaimniecības prece (subprodukts un lejupējāks subprodukts) **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#15) – nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta regulētā tirgū tirgota nākotnes līguma/regulētā tirgū netirgota nākotnes līguma nosacītā summa			10 000 000 EUR	10

▼M3

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām robežvērtībām**	
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
	3. segmentācijas kritērijs (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks regulētā tirgū tirgota nākotnes līguma/ regulētā tirgū netirgota nākotnes līguma termiņu grupā ir definēts šādi: **1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši **2. termiņu grupa:** 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši **3. termiņu grupa:** 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads **4. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi … **m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi		
Lauksaimniecības preču iespējas līgumi RTS2#3 = “DERV” un RTS2#4 = “COMM” un RTS23#35 = “AGRI” un RTS2#5 = “OPTN”	lauksaimniecības preču iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#36 un RTS23#37) – pamatā esošā lauksaimniecības prece (subprodukts un lejupējāks subprodukts) **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#15) – nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta iespējas līguma nosacītā summa **3. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks iespējas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: **1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši **2. termiņu grupa:** 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši **3. termiņu grupa:** 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads **4. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi … **m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	10 000 000 EUR	10

▼M3

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām robežvērtībām**	
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Lauksaimniecības preču mijmaiņas līgumi RTS2#3 = “DERV” un RTS2#4 = “COMM” un RTS23#35 = “AGRI” un RTS2#5 = “SWAP”	lauksaimniecības preču mijmaiņas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#36 un RTS23#37) – pamatā esošā lauksaimniecības prece (subprodukts un lejupējāks subprodukts) **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#15) – nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta mijmaiņas līguma nosacītā summa **3. segmentācijas kritērijs** (RTS23#34) – piegādes veids, kas definēts kā norēķins ar naudu, fiziskiem aktīviem vai pēc izvēles **4. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: **1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši **2. termiņu grupa:** 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši **3. termiņu grupa:** 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads **4. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi … **m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	10 000 000 EUR	10
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi**		
Citi preču atvasinātie instrumenti preču atvasinātais instruments, kas nepieder nevienai no iepriekšminētajām aktīvu apakšklasēm	par visiem pārējiem preču atvasinātajiem instrumentiem uzskata, ka tiem nav likvīda tirgus		

▼M4

7.2. tabula

Preču atvasinātie instrumenti –pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti									
Aktīvu apakšklase	**Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus**								
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	***LIS* pirmstirdzniecība**		***SSTI* pēctirdzniecība**			***LIS* pēctirdzniecība**		
		Tirdzniecība – procentīle	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**
Regulētā tirgū tirgoti metālu preču nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti metālu preču nākotnes līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	500 000 EUR	80.	60.	750 000 EUR	90.	70.	1 000 000 EUR
Metālu preču iespējas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	500 000 EUR	80.	60.	750 000 EUR	90.	70.	1 000 000 EUR
Metālu preču mijmaiņas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	500 000 EUR	80.	60.	750 000 EUR	90.	70.	1 000 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti									
Aktīvu apakšklase	**Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus**								
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	***LIS* pirmstirdzniecība**		***SSTI* pēctirdzniecība**			***LIS* pēctirdzniecība**		
		Tirdzniecība – procentīle	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**
Regulētā tirgū tirgoti energopreču nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti energopreču nākotnes līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	500 000 EUR	80.	60.	750 000 EUR	90.	70.	1 000 000 EUR
Energopreču iespējas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	500 000 EUR	80.	60.	750 000 EUR	90.	70.	1 000 000 EUR
Energopreču mijmaiņas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	500 000 EUR	80.	60.	750 000 EUR	90.	70.	1 000 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti									
Aktīvu apakšklase	**Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus**								
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	***LIS* pirmstirdzniecība**		***SSTI* pēctirdzniecība**			***LIS* pēctirdzniecība**		
		Tirdzniecība – procentīle	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**
Regulētā tirgū tirgoti lauksaimniecības preču nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti lauksaimniecības preču nākotnes līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	500 000 EUR	80.	60.	750 000 EUR	90.	70.	1 000 000 EUR
Lauksaimniecības preču iespējas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	500 000 EUR	80.	60.	750 000 EUR	90.	70.	1 000 000 EUR
Lauksaimniecības preču mijmaiņas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	500 000 EUR	80.	60.	750 000 EUR	90.	70.	1 000 000 EUR

▼M4

7.3. tabula

Preču atvasinātie instrumenti – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus**		
	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
	Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
Regulētā tirgū tirgoti metālu preču nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti metālu preču nākotnes līgumi	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Metālu preču iespējas līgumi	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Metālu preču mijmaiņas līgumi	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Regulētā tirgū tirgoti energopreču nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti energopreču nākotnes līgumi	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Energopreču iespējas līgumi	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Energopreču mijmaiņas līgumi	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Regulētā tirgū tirgoti lauksaimniecības preču nākotnes līgumi / regulētā tirgū netirgoti lauksaimniecības preču nākotnes līgumi	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Lauksaimniecības preču iespējas līgumi	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Lauksaimniecības preču mijmaiņas līgumi	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Citi preču atvasinātie instrumenti	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR

▼B

8. **Ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti**

▼M3

8.1. tabula

Ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti – klases, kurām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti			
finanšu instruments, kas attiecas uz valūtām, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma C iedaļas 4. punktā			
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām**	
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Regulētā tirgū netirgots nepiegādājams nākotnes līgums (*NDF*) ir regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums, par ko darījumu partneri norēķinās naudā, ja norēķinu summu nosaka divu valūtu maiņas kursu starpība starp tirdzniecības datumu un novērtēšanas datumu. Norēķinu datumā viena puse būs otrai pusei parādā neto starpības summu starp i) tirdzniecības datumā fiksēto valūtas maiņas kursu; un ii) novērtēšanas datumā fiksēto valūtas maiņas kursu, pamatojoties uz nosacīto summu, un šāda neto summa ir jāizmaksā līgumā noteiktajā norēķinu valūtā. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FORW RTS2#26 = NDLV	nepiegādājama ārvalstu valūtas regulētā tirgū netirgota nākotnes līguma apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#13 un RTS23#47) – pamatā esošais valūtu pāris definēts kā divu valūtu kombinācija, kas ir atvasināto instrumentu līguma pamatā **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks regulētā tirgū netirgota nākotnes līguma termiņu grupā ir definēts šādi: **1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 nedēļa **2. termiņu grupa:** 1 nedēļa < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši **3. termiņu grupa:** 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads **4. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi **5. termiņu grupa:** 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … **m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	Tiek uzskatīts, ka nepiegādājamiem regulētā tirgū netirgotiem nākotnes līgumiem (*NDF*) nav likvīda tirgus	

▼M3

Aktīvu klase – ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām**	
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Piegādājams regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums (*DF*) ir regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums, kas ietver tikai divu dažādu valūtu apmaiņu konkrēta regulētā tirgū netirgota nākotnes līguma norēķinu datumā ar fiksētu kursu, par ko panākta vienošanās, noslēdzot līgumu, kas attiecas uz valūtu apmaiņu. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR’ RTS2#5 = FORW RTS2#26 = DLVB	piegādājama ārvalstu valūtas regulētā tirgū netirgota nākotnes līguma apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#13 un RTS23#47) – pamatā esošais valūtu pāris definēts kā divu valūtu kombinācija, kas ir atvasināto instrumentu līguma pamatā **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks regulētā tirgū netirgota nākotnes līguma termiņu grupā ir definēts šādi: **1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 nedēļa **2. termiņu grupa:** 1 nedēļa < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši **3. termiņu grupa:** 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads **4. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi **5. termiņu grupa:** 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … **m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	Tiek uzskatīts, piegādājamiem regulētā tirgū netirgotiem nākotnes līgumiem (*DF*) nav likvīda tirgus	

▼M3

Aktīvu klase – ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām**	
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Nepiegādājami ārvalstu valūtas iespējas līgumi (*NDO*) ir iespējas līgums, par ko darījumu partneri norēķinās naudā, ja norēķinu summu nosaka divu valūtu maiņas kursu starpība starp tirdzniecības datumu un novērtēšanas datumu. Norēķinu datumā viena puse būs otrai pusei parādā neto starpības summu starp i) tirdzniecības datumā fiksēto valūtas maiņas kursu; un ii) novērtēšanas datumā fiksēto valūtas maiņas kursu, pamatojoties uz nosacīto summu, un šāda neto summa ir jāizmaksā līgumā noteiktajā norēķinu valūtā. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR’ RTS2#5 = OPTN RTS2#26 = NDLV	nepiegādājama ārvalstu valūtas iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#13 un RTS23#47) – pamatā esošais valūtu pāris definēts kā divu valūtu kombinācija, kas ir atvasināto instrumentu līguma pamatā **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks iespējas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: **1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 nedēļa **2. termiņu grupa:** 1 nedēļa < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši **3. termiņu grupa:** 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads **4. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi **5. termiņu grupa:** 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … **m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	Tiek uzskatīts, ka nepiegādājamiem ārvalstu valūtas iespējas līgumiem (*NDO*) nav likvīda tirgus	

▼M3

Aktīvu klase – ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām**	
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Piegādājami ārvalstu valūtas iespējas līgumi (*DO*) ir iespējas līgums, kas ietver tikai divu dažādu valūtu apmaiņu konkrēta regulētā tirgū netirgota nākotnes līguma norēķinu datumā ar fiksētu kursu, par ko panākta vienošanās, noslēdzot līgumu, kas attiecas uz valūtu apmaiņu. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = OPTN RTS2#26 = DLVB	piegādājama ārvalstu valūtas iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#13 un RTS23#47) – pamatā esošais valūtu pāris definēts kā divu valūtu kombinācija, kas ir atvasināto instrumentu līguma pamatā **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks iespējas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: **1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 nedēļa **2. termiņu grupa:** 1 nedēļa < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši **3. termiņu grupa:** 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads **4. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi **5. termiņu grupa:** 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … **m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	Tiek uzskatīts, ka piegādājamiem ārvalstu valūtas iespējas līgumiem (*DO*) nav likvīda tirgus	

▼M3

Aktīvu klase – ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām**	
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Nepiegādājami ārvalstu valūtas mijmaiņas līgumi (*NDS*) ir mijmaiņas līgums, par ko saskaņā ar tā noteikumiem darījumu partneri norēķinās naudā, ja norēķinu summu nosaka divu valūtu maiņas kursu starpība starp tirdzniecības datumu un novērtēšanas datumu. Norēķinu datumā viena puse būs otrai pusei parādā neto starpības summu starp i) tirdzniecības datumā fiksēto valūtas maiņas kursu; un ii) novērtēšanas datumā fiksēto valūtas maiņas kursu, pamatojoties uz nosacīto summu, un šāda neto summa ir jāizmaksā līgumā noteiktajā norēķinu valūtā. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR'** RTS2#5 = SWAP RTS2#26 = NDLV	nepiegādājama ārvalstu valūtas mijmaiņas līguma apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#13 un RTS23#47) – pamatā esošais valūtu pāris definēts kā divu valūtu kombinācija, kas ir atvasināto instrumentu līguma pamatā **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: **1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 nedēļa **2. termiņu grupa:** 1 nedēļa < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši **3. termiņu grupa:** 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads **4. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi **5. termiņu grupa:** 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … **m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	Tiek uzskatīts, ka nepiegādājamiem ārvalstu valūtas mijmaiņas līgumiem (*NDS*) nav likvīda tirgus	

▼M3

Aktīvu klase – ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām**	
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Piegādājami ārvalstu valūtas mijmaiņas līgumi (*DS*) ir mijmaiņas līgums, kas ietver divu dažādu valūtu apmaiņu konkrēta regulētā tirgū tirgota nākotnes līguma norēķinu datumā ar fiksētu kursu, par ko panākta vienošanās, noslēdzot līgumu, kas attiecas uz valūtu apmaiņu. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = SWAP RTS2#26 = DLVB	piegādājamu ārvalstu valūtas mijmaiņas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#13 un RTS23#47) – pamatā esošais valūtu pāris definēts kā divu valūtu kombinācija, kas ir atvasināto instrumentu līguma pamatā **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: **1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 nedēļa **2. termiņu grupa:** 1 nedēļa < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši **3. termiņu grupa:** 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads **4. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi **5. termiņu grupa:** 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … **m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	Tiek uzskatīts, ka piegādājamiem ārvalstu valūtas mijmaiņas līgumiem (*DS*) nav likvīda tirgus	

▼M3

Aktīvu klase – ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām**	
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Regulētā tirgū tirgoti ārvalstu valūtas nākotnes līgumi **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR'** RTS2#5 = FUTR	regulētā tirgū tirgotu ārvalstu valūtas nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#13 un RTS23#47) – pamatā esošais valūtu pāris definēts kā divu valūtu kombinācija, kas ir atvasināto instrumentu līguma pamatā **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks regulētā tirgū tirgota nākotnes līguma termiņu grupā ir definēts šādi: **1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 nedēļa **2. termiņu grupa:** 1 nedēļa < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši **3. termiņu grupa:** 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads **4. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi **5. termiņu grupa:** 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … **m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	Tiek uzskatīts, ka regulētā tirgū tirgotiem ārvalstu valūtas nākotnes līgumiem nav likvīda tirgus	

Aktīvu klase – ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti	
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi**
Citi ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti ārvalstu valūtas atvasinātais instruments, kas nepieder nevienai no iepriekšminētajām aktīvu apakšklasēm RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = OTHR	par visiem pārējiem ārvalstu valūtas atvasinātajiem instrumentiem uzskata, ka tiem nav likvīda tirgus

▼M4

8.2. tabula

Ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām nav likvīda tirgus**		
	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
	Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
Regulētā tirgū netirgots nepiegādājams nākotnes līgums (*NDF*)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Regulētā tirgū netirgots piegādājams nākotnes līgums (*DF*)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Nepiegādājami ārvalstu valūtas iespējas līgumi (*NDO*)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Piegādājami ārvalstu valūtas iespējas līgumi (*DO*)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Nepiegādājami ārvalstu valūtas mijmaiņas līgumi (*NDS*)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Piegādājami ārvalstu valūtas mijmaiņas līgumi (*DS*)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Regulētā tirgū tirgoti ārvalstu valūtas nākotnes līgumi	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Citi ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR

▼B

9. **Kredītu atvasinātie instrumenti**

▼M3

9.1. tabula

Kredītu atvasinātie instrumenti – klases, kurām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – kredītu atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju**		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Indeksa aktuālais (*on-the-run*) statuss [Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs]
Indeksa kredītriska mijmaiņas līgums (*CDS*) ir mijmaiņas līgums, kura naudas plūsmu apmaiņa ir saistīta ar indeksu veidojošo finanšu instrumentu vairāku emitentu kredītspēju un kredītnotikumiem **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	indeksa kredītriska mijmaiņas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS2#34) — pamatā esošais indekss **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#42) — nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta atvasinātā instrumenta nosacītā summa **3. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks kredītriska mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: **1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads **2. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi, **3. termiņu grupa:** 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … **m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	200 000 000 EUR	10	Tiek uzskatīts, ka pamatā esošajam indeksam ir likvīds tirgus: (1) visā tā “aktuālā statusa” laikā (2) tā 1x zemākas “aktualitātes” statusa pirmajās 30 darbdienās “aktuāls” indekss ir indeksa pašreizējā jaunākā versija (sērija), kas izveidota dienā, kad indeksa saturs stājas spēkā, un kas beidzas dienā pirms datuma, kurā stājas spēkā indeksa nākamās versijas (sērijas) saturs. “1x zemākas aktualitātes statuss” ir tāda indeksa versija (sērija), kas ir spēkā pirms pašreizējās “aktuālās” versijas (sērijas) kādā konkrētā brīdī. Versija (sērija) zaudē “aktuālo” statusu un iegūst “1x zemākas aktualitātes” statusu, kad ir izveidota jaunākā indeksa versija (sērija).

▼M3

Aktīvu klase – kredītu atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju**		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Indeksa aktuālais (*on-the-run*) statuss [Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs]
Ar vienu parādnieku saistīts kredītriska mijmaiņas līgums (CDS) ir mijmaiņas līgums, kura naudas plūsmu apmaiņa ir saistīta ar finanšu instrumentu viena emitenta kredītspēju un kredītnotikumiem **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	ar vienu parādnieku saistīta kredītriska mijmaiņas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS2#41) — pamatā esošā atsauces struktūra **2. segmentācijas kritērijs** (RTS2#39) — pamatā esošās atsauces struktūras veids, kas definēts šādi: “Valsts un publiskā sektora emitents” ir emitenta struktūra, kas ir (a) Savienība; (b) dalībvalsts, tostarp dalībvalsts valdības departaments, aģentūra vai īpašam nolūkam dibināta sabiedrība; (c) publiska struktūra, kas nav minēta a) vai b) apakšpunktā; (d) federālas dalībvalsts gadījumā – minētās federācijas loceklis; (e) vairāku dalībvalstu īpašam nolūkam dibināta sabiedrība; (f) starptautiska finanšu iestāde, kuru izveidojušas divas vai vairākas dalībvalstis un kuras uzdevums ir nodrošināt finansējumu un sniegt finanšu palīdzību tās locekļiem, kurus piemeklējušas smagas finansiāla rakstura problēmas vai kuriem tādas draud;	10 000 000 EUR	10	

▼M3

Aktīvu klase – kredītu atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju**		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Indeksa aktuālais (*on-the-run*) statuss [Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs]
	(g) Eiropas Investīciju banka; (h) publiska struktūra, kas nav valsts emitents, kā norādīts a) līdz c) apakšpunktā. "Kolektīvo ieguldījumu emitents" ir emitenta struktūra, kas nav valsts un publiskā sektora emitents. **3. segmentācijas kritērijs** (RTS2#42) — nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta atvasinātā instrumenta nosacītā summa **4. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) — līdz termiņam atlikušais laiks kredītriska mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: **1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads **2. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi, **3. termiņu grupa:** 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … **m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi			
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst šādam kvalitatīvam likviditātes kritērijam**		
Kredītriska mijmaiņas līguma indeksa iespējas līgumi ir iespējas līgums, kura pamatā esošais instruments ir kredītriska mijmaiņas līguma indekss	kredītriska mijmaiņas līgumu indeksa iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem:	kredītriska mijmaiņas līguma indeksa iespējas līgums, kura pamatā esošais kredītriska mijmaiņas līguma indekss ir apakšklase, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus, un kura līdz termiņam atlikušais laiks termiņu grupā ir 0 līdz 6 mēneši, un par kuru tiek uzskatīts, ka tam ir likvīds tirgus		

▼M3

Aktīvu klase – kredītu atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju**		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Indeksa aktuālais (*on-the-run*) statuss [Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs]
RTS2#3 = DERV **RTS2#4 = CRDT**	**1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#26) — kredītriska mijmaiņas līgumu indeksa apakšklase, kā precizēts attiecībā uz indeksa kredītriska mijmaiņas līgumu aktīvu apakšklasi **2. segmentācijas kritērijs (RTS2#8)** – līdz termiņam atlikušais laiks iespējas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: **1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši **2. termiņu grupa:** 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads, **3. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi, **4. termiņu grupa:** 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … **m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	kredītriska mijmaiņas līguma indeksa iespējas līgums, kura pamatā esošais kredītriska mijmaiņas līguma indekss ir apakšklase, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus, un kura līdz termiņam atlikušais laiks termiņu grupā nav 0 līdz 6 mēneši, un par kuru netiek uzskatīts, ka tam ir likvīds tirgus kredītriska mijmaiņas līguma indeksa iespējas līgums, kura pamatā esošo kredītriska mijmaiņas līguma indekss ir tāda apakšklase, par kuru uzskata, ka tai nav likvīda tirgus konkrētajā līdz termiņam atlikušajā laikā		
Ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas līguma iespējas līgumi ir iespējas līgums, kura pamatā esošais instruments ir ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas līgums **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas līguma iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS23#26) — ar vienu parādnieku saistīta kredītriska mijmaiņas līguma apakšklase, kā precizēts attiecībā uz ar vienu parādnieku saistīta kredītriska mijmaiņas līguma aktīvu apakšklasi	ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas līguma iespējas līgums, kura pamatā esošais ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas līgums ir apakšklase, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus, un kura līdz termiņam atlikušais laiks termiņu grupā ir 0 līdz 6 mēneši, un par kuru tiek uzskatīts, ka tam ir likvīds tirgus ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas līguma iespējas līgums, kura pamatā esošais ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas līgums ir apakšklase, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus, un kura līdz termiņam atlikušais laiks termiņu grupā nav 0 līdz 6 mēneši, un par kuru netiek uzskatīts, ka tam ir likvīds tirgus		

▼M3

Aktīvu klase – kredītu atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju**		
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Indeksa aktuālais (*on-the-run*) statuss [Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs]
	2. segmentācijas kritērijs (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks iespējas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: **1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši **2. termiņu grupa:** 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads, **3. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi, **4. termiņu grupa:** 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … **m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas līguma iespējas līgums, kura pamatā esošais ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas līgums ir tāda apakšklase, par kuru uzskata, ka tai nav likvīda tirgus, par kuru uzskata, ka tai nav likvīda tirgus konkrētajā līdz termiņam atlikušajā laikā		

Aktīvu klase – kredītu atvasinātie instrumenti	
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi**
Citi kredītu atvasinātie instrumenti ir kredīta atvasinātais instruments, kas nepieder nevienai no iepriekšminētajām aktīvu apakšklasēm **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT** RTS2#5 = OTHR	par visiem pārējiem kredītu atvasinātajiem instrumentiem uzskata, ka tiem nav likvīda tirgus

▼M4

9.2. tabula

Kredītu atvasinātie instrumenti – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus

Aktīvu klase – kredītu atvasinātie instrumenti									
Aktīvu apakšklase	**Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus**								
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	***LIS* pirmstirdzniecība**		***SSTI* pēctirdzniecība**			***LIS* pēctirdzniecība**		
		Tirdzniecība – procentīle	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**
Indeksa kredītriska mijmaiņas darījums (*CDS*)	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	5 000 000 EUR	80.	60.	7 500 000 EUR	90.	70.	10 000 000 EUR
Ar vienu parādnieku saistīts kredītriska mijmaiņas līgums (*CDS*)	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	5 000 000 EUR	80.	60.	7 500 000 EUR	90.	70.	10 000 000 EUR
Kredītriska mijmaiņas līguma indeksa iespējas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	5 000 000 EUR	80.	60.	7 500 000 EUR	90.	70.	10 000 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – kredītu atvasinātie instrumenti									
Aktīvu apakšklase	**Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus**								
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	***LIS* pirmstirdzniecība**		***SSTI* pēctirdzniecība**			***LIS* pēctirdzniecība**		
		Tirdzniecība – procentīle	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**
Ar vienu parādnieku saistīta kredītriska mijmaiņas līguma iespējas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	5 000 000 EUR	80.	60.	7 500 000 EUR	90.	70.	10 000 000 EUR

9.3. tabula

Kredītu atvasinātie instrumenti – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – kredītu atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām nav likvīda tirgus**		
	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
	Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
Indeksa kredītriska mijmaiņas darījums (*CDS*)	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Ar vienu parādnieku saistīts kredītriska mijmaiņas līgums (*CDS*)	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Kredītriska mijmaiņas līguma indeksa iespējas līgumi	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Ar vienu parādnieku saistīta kredītriska mijmaiņas līguma iespējas līgumi	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Citi kredīta atvasinātie instrumenti	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR

▼B

10. **C10 atvasinātie instrumenti**

▼M3

10.1. tabula

C10 atvasinātie instrumenti – klases, kurām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – C10 atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām**	
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Kravu pārvadājumu likmes atvasinātie instrumenti finanšu instruments, kas attiecas uz kravu pārvadājumu likmēm, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma C iedaļas 10. punktā RTS2#3 = "DERV" un RTS2#4 = "COMM" un RTS23#35 = "FRGT"	kravu pārvadājumu likmes atvasināto instrumentu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: **1. segmentācijas kritērijs** (RTS2#5) – līguma veids: regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi vai iespējas līgumi **2. segmentācijas kritērijs** (RTS23#36) – kravas veids **3. segmentācijas kritērijs** (RTS2#37) – kravas paveids **4. segmentācijas kritērijs** (RTS2#12) – ar kravas paveidu saistīta apjoma apraksts **5. segmentācijas kritērijs** (RTS2#13) – konkrēta maršruta vai fraktēšanas vidējais rādītājs **6. segmentācijas kritērijs** (RTS2#8) – līdz termiņam atlikušais laiks atvasinātā instrumenta termiņu grupā ir definēts šādi: **1. termiņu grupa:** 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis **2. termiņu grupa:** 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši **3. termiņu grupa:** 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši **4. termiņu grupa:** 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 9 mēneši **5. termiņu grupa:** 9 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads **6. termiņu grupa:** 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	10 000 000 EUR	10

▼M3

Aktīvu klase – C10 atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām**	
		Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
	7. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi … **m termiņu grupa:** (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi		

Aktīvu klase – C10 atvasinātie instrumenti	
Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi**
Citi C10 atvasinātie instrumenti finanšu instruments, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma C iedaļas 10. punktā, kas nav "kravas pārvadājumu likmes atvasinātais instruments", jebkura no turpmāk minētajām procentu likmju atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasēm: "Inflācijai piesaistītu vairāku valūtu mijmaiņas līgums vai starpvalūtu mijmaiņas līgums", "inflācijai piesaistītam vairāku valūtu mijmaiņas līgumam vai starpvalūtu mijmaiņas līgumam piesaistīts regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums", "inflācijai piesaistīts vienas valūtas mijmaiņas līgums", "inflācijai piesaistītam vienas valūtas mijmaiņas līgumam piesaistīts regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums" un kāda no turpmāk minētajām kapitāla vērtspapīru atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasēm: "Svārstīguma indeksa iespējas līgums", "svārstīguma indeksa regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums", mijmaiņas līgums ar ieņēmumu dispersijas parametru, mijmaiņas līgums ar ieņēmumu svārstīguma parametru, portfeļa mijmaiņas līgums ar ieņēmumu dispersijas parametru, portfeļa mijmaiņas līgums ar ieņēmumu svārstīguma parametru	par visiem pārējiem C10 atvasinātajiem instrumentiem uzskata, ka tiem nav likvīda tirgus

▼M4

10.2. tabula

C10 atvasinātie instrumenti – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kuram konstatēts, ka tām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – C10 atvasinātie instrumenti									
Aktīvu apakšklase	**Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus**								
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	***LIS* pirmstirdzniecība**		***SSTI* pēctirdzniecība**			***LIS* pēctirdzniecība**		
		Tirdzniecība – procentīle	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**
Kravu pārvadājumu likmes atvasinātie instrumenti	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	70.	50 000 EUR	80.	60.	75 000 EUR	90.	70.	100 000 EUR

10.3. tabula

C10 atvasinātie instrumenti – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – C10 atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām nav likvīda tirgus**		
	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
	Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
Kravu pārvadājumu likmes atvasinātie instrumenti	50 000 EUR	75 000 EUR	100 000 EUR
Citi C10 atvasinātie instrumenti	50 000 EUR	75 000 EUR	100 000 EUR

▼B

11. **Finanšu līgumi par cenu starpībām**

▼M3

11.1. tabula

***CFD* – klases, kurām nav likvīda tirgus**

Aktīvu apakšklase	**Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk**	Kvalitatīvais likviditātes kritērijs	**Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*)** [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Līgumi par valūtas cenu starpībām RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = CURR	līguma par valūtas cenu starpībām apakšklasi raksturo pamatā esošais valūtu pāris, kas definēts kā divu valūtu kombinācija, kas ir līguma par cenu starpībām/starpību derību līguma pamatā. RTS2#30 un RTS2#31		50 000 000 EUR	100
Preces *CFD* RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = COMM	līguma par preču cenu starpībām apakšklasi definē pamatā esošais līgums par preču cenu starpībām/starpību derību līgums RTS23#35 un RTS23#36 un RTS23#37		50 000 000 EUR	100
Līgumi par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = EQUI	līguma par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām apakšklasi definē pamatā esošais līgums par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām/starpību derību līgums RTS23#26	uzskata, ka līguma par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām apakšklasei ir likvīds tirgus, ja pamatā esošais instruments ir kapitāla vērtspapīrs, kuram ir likvīds tirgus, kā noteikts saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 2. panta 1. punkta 17. apakšpunkta b) punktu		
Līgumi par obligāciju cenu starpībām RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = BOND	līguma par obligāciju cenu starpībām apakšklasi definē pamatā esošā obligācija vai līguma par cenu starpībām regulētā tirgū tirgots obligāciju nākotnes līgums/starpību derību līgums RTS23#26	uzskata, ka līguma par kapitāla obligāciju cenu starpībām apakšklasei ir likvīds tirgus, ja pamatā esošais instruments ir obligācija vai regulētā tirgū tirgots obligāciju nākotnes līgums, kuram ir likvīds tirgus, kā noteikts saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1.punkta b) apakšpunktu.		

▼M3

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Kvalitatīvais likviditātes kritērijs	Dienas vidējā nosacītā summa (*ADNA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Regulētā tirgū tirgotiem kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumiem/regulētā tirgū netirgotiem kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumiem piesaistīti līgumi par cenu starpībām RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = FTEQ	līguma par cenu starpībām, kas piesaistīts regulētā tirgū tirgotam kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumam/regulētā tirgū netirgotam kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumam, apakšklasi definē pamatā esošais regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums, kas piesaistīts līgumam par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām/starpību derību līgumam RTS23#26	uzskata, ka līguma par cenu starpībām, kas piesaistīts regulētā tirgū tirgota kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumam/regulētā tirgū netirgota kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumam, apakšklasei ir likvīds tirgus, ja pamatā esošais instruments ir regulētā tirgū tirgots kapitāla vērtspapīru nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots kapitāla vērtspapīru nākotnes līgums, kuram ir likvīds tirgus, kā noteikts saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu.		
Kapitāla vērtspapīru iespējas līgumam piesaistīti līgumi par cenu starpībām RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OPEQ	līguma par cenu starpībām, kas piesaistīts kapitāla vērtspapīru iespējas līgumiem, apakšklasi definē pamatā esošais iespējas līgums, kas piesaistīts līgumam par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām/starpību derību līgumam RTS23#26	uzskata, ka līguma par cenu starpībām, kas piesaistīts kapitāla vērtspapīru iespējas līgumiem, apakšklasei ir likvīds tirgus, ja pamatā esošais instruments ir kapitāla vērtspapīru iespējas līgums, kuram ir likvīds tirgus, kā noteikts saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu.		

Aktīvu klase – finanšu līgumi par cenu starpībām (*CFD*)

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi
Citi finanšu līgumi par cenu starpībām	
līgums par cenu starpībām/ starpību derību līgums, kas nepieder nevienai no iepriekšminētajām aktīvu apakšklasēm RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OTHR	par visiem pārējiem līgumiem par cenu starpībām/starpību derību līgumiem uzskata, ka tiem nav likvīda tirgus

▼M4

11.2. tabula

CFD – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības _SSTI_ un _LIS_ robežvērtības apakšklasēm, par kuram konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus

Aktīvu klase – finanšu līgumi par cenu starpībām (*CFD*)									
Aktīvu apakšklase	**Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus**								
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	***LIS* pirmstirdzniecība**		***SSTI* pēctirdzniecība**			***LIS* pēctirdzniecība**		
		Tirdzniecība – procentīle	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**
Līgumi par valūtas cenu starpībām	darījumi, kas veikti ar līgumu par valūtas cenu starpībām, par kuriem konstatēts, ka tiem ir likvīds tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu	70.	60 000 EUR	80.	60.	90 000 EUR	90.	70.	100 000 EUR
Līgumi par preču cenu starpībām	darījumi, kas veikti ar līgumu par preču cenu starpībām, par kuriem konstatēts, ka tiem ir likvīds tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu	70.	60 000 EUR	80.	60.	90 000 EUR	90.	70.	100 000 EUR
Līgumi par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām	darījumi, kas veikti ar līgumu par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām, par kuriem uzskata, ka tiem ir likvīds tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu	70.	60 000 EUR	80.	60.	90 000 EUR	90.	70.	100 000 EUR
Līgumi par obligāciju cenu starpībām	darījumi, kas veikti ar līgumu par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām, par kuriem uzskata, ka tiem ir likvīds tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu	70.	60 000 EUR	80.	60.	90 000 EUR	90.	70.	100 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – finanšu līgumi par cenu starpībām (*CFD*)									
Aktīvu apakšklase	**Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus**								
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	***LIS* pirmstirdzniecība**		***SSTI* pēctirdzniecība**			***LIS* pēctirdzniecība**		
		Tirdzniecība – procentīle	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Apjoms – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**
Līgumi par cenu starpībām par regulētā tirgū tirgotiem kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumiem / regulētā tirgū netirgotiem kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumiem	darījumi, kas veikti ar līgumiem par cenu starpībām par regulētā tirgū tirgotiem kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumiem, par kuriem uzskata, ka tiem ir likvīds tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu	70.	60 000 EUR	80.	60.	90 000 EUR	90.	70.	100 000 EUR
Līgumi par cenu starpībām par kapitāla vērtspapīru iespējas līgumiem	darījumi, kas veikti ar līgumiem par cenu starpībām par kapitāla vērtspapīru iespējas līgumiem, par kuriem uzskata, ka tiem ir likvīds tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu	70.	60 000 EUR	80.	60.	90 000 EUR	90.	70.	100 000 EUR

11.3. tabula

Līgumi par cenu starpībām – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – finanšu līgumi par cenu starpībām (*CFD*)			
Aktīvu apakšklase	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām nav likvīda tirgus**		
	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
	Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
Līgumi par valūtas cenu starpībām	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Līgumi par preču cenu starpībām	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

▼M4

Aktīvu klase – finanšu līgumi par cenu starpībām (*CFD*)			
Aktīvu apakšklase	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām nav likvīda tirgus**		
	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
	Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
Līgumi par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Līgumi par obligāciju cenu starpībām	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Līgumi par cenu starpībām par regulētā tirgū tirgotiem kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumiem / regulētā tirgū netirgotiem kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumiem	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Līgumi par cenu starpībām par kapitāla vērtspapīru iespējas līgumiem	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Citi līgumi par cenu starpībām / starpību derību līgumi	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

12. **Emisijas kvotas**

12.1. tabula

Emisijas kvotas – klases, kurām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – emisijas kvotas	
Lai noteiktu aktīvu apakšklases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6.a pantu, piemēro šādu metodi:	
Aktīvu apakšklase	**Likviditātes noteikšana**
Eiropas Savienības emisijas kvotas (*EUA*) – jebkura struktūra, kas atzīta par atbilstīgu Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2003/87/EK ([1]) prasībām (emisijas kvotu tirdzniecības sistēma), kas atbilst tiesībām emitēt vienu tonnu oglekļa dioksīda (tCO_2e) ekvivalenta RTS2#3 = EMAL un RTS23#37 = EUAE	Tiek uzskatīts, ka Eiropas Savienības emisijas kvotām (*EUA*) ir likvīds tirgus
Visas pārējās emisijas kvotas RTS2#3 = EMAL un RTS23#37 <> EUAE	Visas pārējās emisijas kvotas, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus

([1]) Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīva 2003/87/EK (2003. gada 13. oktobris), ar kuru nosaka sistēmu siltumnīcas efektu izraisošo gāzu emisijas kvotu tirdzniecībai Kopienā un groza Padomes Direktīvu 96/61/EK (OV L 275, 25.10.2003., 32. lpp., ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2003/87/oj).

▼M4

12.2. tabula

Emisijas kvotas – pirmstirdzniecības *LIS* robežvērtība un pēctirdzniecības apjoma robežvērtība

Aktīvu klase – emisijas kvotas		
Aktīvu apakšklase	***LIS* pirmstirdzniecība**	**Pēctirdzniecības apjoma robežvērtība**
Eiropas Savienības emisijas kvotas (*EUA*)	5 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas
Visas pārējās emisijas kvotas	Jebkāds apjoms	Jebkāds apjoms

▼B

13. **Emisiju kvotu atvasinātie instrumenti**

▼M3

13.1. tabula

Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti – klases, kurām nav likvīda tirgus

	Aktīvu klase – emisijas kvotu atvasinātie instrumenti	
Aktīvu apakšklase	**Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām**	
	Dienas vidējā summa (*ADA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no Eiropas Savienības emisijas kvotām (*EUA*) finanšu instruments, kas attiecas uz emisijas kvotām, kas ir Eiropas Savienības emisijas kvotu veids, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma C iedaļas 4. punktā RTS2#3 = DERV un RTS2#4 = EMAL un RTS2#43 = EUAE	150 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	5

▼M3

Aktīvu apakšklase	Aktīvu klase – emisijas kvotu atvasinātie instrumenti	
	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām	
	Dienas vidējā summa (*ADA*) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	**Dienas vidējais darījumu skaits** [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no Eiropas Savienības aviācijas nozares kvotām (*EUAA*) finanšu instruments, kas attiecas uz emisijas kvotām, kas ir Eiropas Savienības aviācijas nozares kvotu (*EUAA*) veids, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma C iedaļas 4. punktā RTS2#3 = DERV un RTS2#4 = EMAL un RTS2#43 = EUAA	150 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	5
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no sertificētas emisijas samazināšanas vienībām (*CER*) finanšu instruments, kas attiecas uz emisijas kvotām, uz ko attiecas Sertificētas emisijas samazināšana, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma C iedaļas 4. punktā RTS2#3 = DERV un RTS2#4 = EMAL un RTS2#43 = CERE	150 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	5
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no emisijas samazināšanas vienībām (*ERU*) finanšu instruments, kas attiecas uz emisijas kvotām, kas ir emisijas samazināšanas vienību (*ERU*) veids, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma C iedaļas 4. punktā RTS2#3 = DERV un RTS2#4 = EMAL un RTS2#43 = ERUE	150 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	5
Citi emisiju kvotu atvasinātie instrumenti emisijas kvotas atvasinātais instruments, kura pamatā esošais instruments ir emisijas kvotas, kuras ir atzītas par atbilstīgām Direktīvas 2003/87/EK prasībām (emisijas kvotu tirdzniecības sistēma) un kuras nav Eiropas Savienības emisijas kvotas (*EUA*), Eiropas Savienības aviācijas nozares kvotas (*EUAA*), Sertificēta emisiju samazināšana (*CER*) un Emisijas samazināšanas vienības (*ERU*) RTS2#3 = DERV un RTS2#4 = EMAL un RTS2#43 = OTHR	visi pārējie emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, par kuriem uzskata, ka tiem nav likvīda tirgus	

▼M4

13.2. tabula

Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības aktīvu apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvīds tirgus

Aktīvu klase – emisijas kvotu atvasinātie instrumenti							
Aktīvu apakšklase	**Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības**	**Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai aktīvu apakšklasei, par kuru uzskata, ka tai ir likvīds tirgus**					
		***LIS* pirmstirdzniecība**		***SSTI* pēctirdzniecība**		***LIS* pēctirdzniecība**	
		Tirdzniecība – procentīle	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no Eiropas Savienības emisijas kvotām (*EUA*)	darījumi, kas izpildīti ar visiem emisijas kvotu atvasinātajiem instrumentiem, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no Eiropas Savienības emisijas kvotām (*EUA*)	70.	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	80.	90 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	90.	100 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no Eiropas Savienības aviācijas nozares kvotām (*EUAA*)	darījumi, kas izpildīti ar visiem emisijas kvotu atvasinātajiem instrumentiem, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no Eiropas Savienības aviācijas nozares kvotām (*EUAA*)	70.	25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	80.	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	90.	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no sertificētas emisijas samazināšanas vienībām (*CER*)	darījumi, kas izpildīti ar visiem emisijas kvotu atvasinātajiem instrumentiem, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no sertificētas emisijas samazināšanas vienībām (*CER*)	70.	25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	80.	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	90.	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas

▼M4

Aktīvu klase – emisijas kvotu atvasinātie instrumenti							
Aktīvu apakšklase	**Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības**	**Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības katrai aktīvu apakšklasei, par kuru uzskata, ka tai ir likvīds tirgus**					
		***LIS* pirmstirdzniecība**		***SSTI* pēctirdzniecība**		***LIS* pēctirdzniecība**	
		Tirdzniecība – procentīle	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**	**Tirdzniecība – procentīle**	**Minimālā robežvērtība**
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no emisijas samazināšanas vienībām (*ERU*)	darījumi, kas izpildīti ar visiem emisijas kvotu atvasinātajiem instrumentiem, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no emisijas samazināšanas vienībām (*ERU*)	70.	25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	80.	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	90.	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas

13.3. tabula

Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības aktīvu apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – emisijas kvotu atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības aktīvu apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus**		
	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
	Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no Eiropas Savienības emisijas kvotām (*EUA*)	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	90 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	100 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no Eiropas Savienības aviācijas nozares kvotām (*EUAA*)	25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas

▼M4

Aktīvu klase – emisijas kvotu atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	**Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības *SSTI* un *LIS* robežvērtības aktīvu apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus**		
	***LIS* pirmstirdzniecība**	***SSTI* pēctirdzniecība**	***LIS* pēctirdzniecība**
	Robežvērtības vērtība	**Robežvērtības vērtība**	**Robežvērtības vērtība**
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no sertificētas emisijas samazināšanas vienībām (*CER*)	25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no emisijas samazināšanas vienībām (*ERU*)	25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas
Citi emisiju kvotu atvasinātie instrumenti	25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas

▼B

IV PIELIKUMS

Atsauces dati, kas jāsniedz pārredzamības aprēķinu nolūkā

▼M3
▼C1

1. tabula

2. tabulas simbolu tabula

SIMBOLS	DATU TIPS	DEFINĪCIJA
{ALPHANUM-n}	Līdz n burtciparu zīmēm	Brīvas formas teksta lauks.
{DECIMAL-n/m}	Decimālskaitlis, kas sastāv no n cipariem, no kuriem maksimāli m cipari var būt cipari aiz komata	Ciparu lauks gan pozitīvām, gan negatīvām vērtībām: 1. decimāldaļas atdala ar “.” (punkts); 2. skaitlim priekšā var būt norādīta “–” (mīnusa zīme), lai norādītu negatīvus skaitļus. Attiecīgā gadījumā vērtības noapaļo un nesaīsina.
{COUNTRYCODE_2}	2 burtciparu zīmes	Valsts divburtu kods, kā definēts ar ISO 3166-1 alpha-2 valsts kodiem.
{CURRENCYCODE_3}	3 burtciparu zīmes	Valūtas trīsburtu kods, kā definēts ar ISO 4217 valūtas kodiem.
{DATEFORMAT}	Datuma formāts saskaņā ar *ISO* 8601	Datumus norāda šādā formātā: GGGG-MM-DD.
{ISIN}	12 burtciparu zīmes	*ISIN* kods, kā definēts *ISO* 6166.
{LEI}	20 burtciparu zīmes	Juridiskās personas identifikators, kas definēts *ISO* 17442.
{MIC}	4 burtciparu zīmes	Tirgus identifikators, kas definēts *ISO* 10383.
{EIC}	16 burtciparu zīmes	*EIC* kods, kas attiecas uz piegādes punktu Eiropas Savienībā vai ārpus tās
{INDEX}	4 burtciparu zīmes	“EONA” – EONIA “EONS” – EONIA mijmaiņas darījums “EURI” – EURIBOR “EUUS” – EURODOLLAR “EUCH” – EuroSwiss “GCFR” – GCF pārdošana ar atpirkšanu (repo) “ISDA” – ISDAFIX “LIBI” – LIBID “LIBO” – LIBOR “MAAA” – pašvaldību parādzīmes (AAA) “PFAN” – ķīlu zīmes “TIBO” – TIBOR “STBO” – STIBOR “BBSW” – BBSW “JIBA” – JIBAR “BUBO” – BUBOR “CDOR” – CDOR

▼C1

SIMBOLS	DATU TIPS	DEFINĪCIJA
		“CIBO” – CIBOR “MOSP” — MOSPRIM “NIBO” — NIBOR “PRBO” — PRIBOR “TLBO” — TELBOR “WIBO” — WIBOR “TREA” — valsts izdotu vērtspapīru ienesīgums “SWAP” – mijmaiņas līgumi “FUSW” – nākotnes mijmaiņas darījums

▼M3

2. tabula

Pārskats par atsauces datiem, kas jāsniedz pārredzamības aprēķinu nolūkā

#	LAUKS	UZRĀDĀMĀ INFORMĀCIJA	ZIŅOJUMU IESNIEGŠANAS FORMĀTS
1	Instrumenta identifikācijas kods	Kods, ko izmanto finanšu instrumenta identificēšanai	{ISIN}
2	Instrumenta pilns nosaukums	Finanšu instrumenta pilns nosaukums	{ALPHANUM-350}
3	FITR identifikators	**Finanšu instrumentu, kas nav kapitāla vērtspapīru finanšu instrumenti, identifikācija** **Vērtspapīroti atvasinātie instrumenti**, kā definēts III pielikuma 4. iedaļas 4.1. tabulā **Strukturētā finansējuma produkti (SFP)**, kā definēts Regulas (ES) Nr. 600/2014 2. panta 1. punkta 28) apakšpunktā **Obligācijas (attiecībā uz visām obligācijām, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes)**, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES 4. panta 1. punkta 44. apakšpunkta b) punktā **Biržā tirgotas preces (*ETC*)**, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES 4. panta 1. punkta 44) apakšpunkta b) punktā un turpmāk precizēts III pielikuma 2. iedaļas 2.4. tabulā **Biržā tirgotas parādzīmes (*ETN*)**, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES 4. panta 1. punkta 44) apakšpunkta b) punktā un turpmāk precizēts III pielikuma 2. iedaļas 2.4. tabulā **Emisijas kvotas**, kā definēts III pielikuma 12. iedaļas 12.1. tabulā **Atvasināts instruments**, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma C iedaļas 4. līdz 10. punktā	**Finanšu instrumenti, kas nav kapitāla vērtspapīru finanšu instrumenti:** “SDRV” – vērtspapīroti atvasinātie instrumenti “SFPS” – strukturētie finanšu produkti (SFP) “BOND” – obligācijas “ETCS” – biržā tirgotas preces “ETNS” – biržā tirgotas parādzīmes “EMAL” – emisijas kvotas “DERV” – atvasinātais instruments

▼M3

#	LAUKS	UZRĀDĀMĀ INFORMĀCIJA	ZIŅOJUMU IESNIEGŠANAS FORMĀTS
4	Pamatā esošā instrumenta aktīvu klase	Jāaizpilda, ja FITR identifikators ir vērtspapīrots atvasinātais instruments vai atvasinātais instruments.	“INTR” – procentu likme “EQUI” – kapitāla vērtspapīri “COMM” – prece “CRDT” – kredīts “CURR” – valūta “EMAL” – emisijas kvotas “OCTN” – Citi C10
5	Līguma veids	Jāaizpilda, ja FITR identifikators ir atvasinātais instruments.	“OPTN” – iespējas līgums “FUTR” – regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi (tostarp – regulētā tirgū netirgoti kravas nākotnes līgumi (*FFA*)) “FRAS” – regulētā tirgū netirgots procentu likmes nākotnes līgums (*FRA*) “FORW” – regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi “SWAP” – mijmaiņas līgumi “SWAP” – portfeļa mijmaiņas līgumi “SWPT” – mijmaiņas iespējas līgumi “OPTS” – mijmaiņas līgumam piesaistīts iespējas līgums “FONS” – mijmaiņas līgumam piesaistīts regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums “FWOS” – mijmaiņas līgumam piesaistīts regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums “SPDB” – starpību derību līgums “CFDS” – līgumi par cenu starpībām “OTHR” – Cits
6	Pārskata sniegšanas diena	Diena, par kuru sniedz atsauces datus	{DATEFORMAT}
7	Tirdzniecības vieta	Segmenta *MIC* tirdzniecības vietai, ja tāds ir; pretējā gadījumā operatīvais *MIC*.	{MIC}
8	Termiņš	Finanšu instrumenta noteiktais termiņš Lauks, kurā norāda obligāciju aktīvu klases, procentu likmju atvasinātos instrumentus, kapitāla vērtspapīru atvasinātos instrumentus, preču atvasinātos instrumentus, ārvalstu valūtas atvasinātos instrumentus, kredītu atvasinātos instrumentus, C10 atvasinātos instrumentus un emisijas kvotu atvasinātos instrumentus.	{DATEFORMAT}

Ar obligācijām (visi obligāciju veidi, izņemot ar biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes) saistīti lauki

Laukus šajā iedaļā aizpilda tikai attiecībā uz obligācijām, kā definēts III pielikuma 2. iedaļas 2.1. tabulā

9	Obligācijas veids	Obligācijas veids, kā precizēts III pielikuma 2. iedaļas 2.2. tabulā. Jāaizpilda tikai, ja FITR identifikators ir līdzvērtīgs obligācijām.	“EUSB” – valsts obligācija “OEPB” – cita publiska obligācija “CVTB” – konvertējama obligācija “CVDB” – segtā obligācija “CVPB” – uzņēmuma obligācija “OTHR” – Cita

▼M3

10	Emisijas datums	Datums, kurā obligācija ir emitēta un sāk uzkrāt procentus.	{DATEFORMAT}

Ar emisijas kvotām saistītie lauki

Laukus šajā iedaļā aizpilda tikai attiecībā uz emisijas kvotām, kā definēts III pielikuma 12. iedaļas 12.1. tabulā

11	Emisijas kvotu paveids	Emisijas kvotas	“CERE” – CER “ERUE” – ERU “EUAE” – EUA “EUAA” – EUAA “OTHR” – Cits

Ar atvasinātajiem instrumentiem saistītie lauki

Preču atvasinātie instrumenti un C10 atvasinātie instrumenti

Laukus šajā iedaļā aizpilda tikai attiecībā uz preču atvasinātajiem instrumentiem, kā definēts III pielikuma 7. iedaļas 7.1. tabulā, un attiecībā uz C10 atvasinātajiem instrumentiem, kā definēts III pielikuma 10. iedaļas 10.1. tabulā

12	Ar kravas paveidu saistīta apjoma apraksts	Jāaizpilda, ja bāzes produkts, kas precizēts Deleģētās regulas (ES) 2017/585 pielikuma 2. tabulas 35. laukā, ir līdzvērtīgs kravai.	Sausai kravai: “CAPE” – Capesize “PNMX” – Panamax “SPMX” – Supramax “HAND” – Handysize Slapjai kravai: “CLAN” – Tīra “DRTY” – Netīra {ALPHANUM-4} citos gadījumos
13	Konkrēta maršruta vai fraktēšanas vidējais rādītājs	Jāaizpilda, ja bāzes produkts, kas precizēts Komisijas Deleģētās regulas (ES) 2017/585 pielikuma 2. tabulas 35. laukā, ir līdzvērtīgs kravai.	Slapjai kravai: “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

			Sausai kravai: “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} citos gadījumos
14	Piegādes/norēķina ar naudu vieta	Jāaizpilda, ja bāzes produkts, kas precizēts Deleģētās regulas (ES) 2017/585 pielikuma 2. tabulas 35. laukā, ir līdzvērtīgs enerģijai.	{EIC} elektroenerģijai vai dabasgāzei “OTHR” – Cita
15	Nosacītā valūta	Valūta, kurā ir denominēta nosacītā summa.	{CURRENCYCODE_3}

Procentu likmju atvasinātie instrumenti

Laukus šajā iedaļā aizpilda tikai attiecībā uz procentu likmju atvasinātajiem instrumentiem, kā definēts III pielikuma 5. iedaļas 5.1. tabulā

16	Pamatā esošā instrumenta veids	Jāaizpilda attiecībā uz līguma veidu, kas nav mijmaiņas līgumi, mijmaiņas iespējas līgumi, mijmaiņas līgumam piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi un mijmaiņas līgumam piesaistīti regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi, ar kādu no norādītajiem variantiem ********** Jāaizpilda ar kādu no norādītajiem variantiem attiecībā uz mijmaiņas līgumiem, mijmaiņas iespējas līgumiem, mijmaiņas līgumam piesaistītiem iespējas līgumiem, mijmaiņas līgumam piesaistītiem regulētā tirgū tirgotiem nākotnes līgumiem un mijmaiņas līgumam piesaistītiem regulētā tirgū netirgotiem nākotnes līgumiem, ņemot vērā pamatā esošo mijmaiņas līgumu	“BOND” – obligācija “BNDF” – regulētā tirgū tirgoti obligāciju nākotnes līgumi “INTR” – procentu likme “IFUT” – regulētā tirgū tirgoti procentu likmes nākotnes līgumi ********** “FFMC” – MAINĪGO PROCENTU LIKMJU VAIRĀKU VALŪTU MIJMAIŅAS LĪGUMI “XFMC” – FIKSĒTĀS UN MAINĪGĀS PROCENTU LIKMES VAIRĀKU VALŪTU MIJMAIŅAS LĪGUMI “XXSC” – FIKSĒTO PROCENTU LIKMJU VAIRĀKU VALŪTU MIJMAIŅAS LĪGUMI “OSMC” – UZ NAKTI IZSNIEGTO KREDĪTU INDEKSA VAIRĀKU VALŪTU MIJMAIŅAS LĪGUMI “IFMC” – INFLĀCIJAI PIESAISTĪTI VAIRĀKU VALŪTU MIJMAIŅAS LĪGUMI “FFSC” – MAINĪGO PROCENTU LIKMJU VIENAS VALŪTAS MIJMAIŅAS LĪGUMI “XFSC” – FIKSĒTĀS UN MAINĪGĀS PROCENTU LIKMES VIENAS VALŪTAS MIJMAIŅAS LĪGUMI

▼M3

			“XXSC” – FIKSĒTO PROCENTU LIKMJU VIENAS VALŪTAS MIJMAIŅAS LĪGUMI “OSSC” – UZ NAKTI IZSNIEGTO KREDĪTU INDEKSA VIENAS VALŪTAS MIJMAIŅAS LĪGUMI “IFSC” – INFLĀCIJAI PIESAISTĪTI VIENAS VALŪTAS MIJMAIŅAS LĪGUMI
17	Pamatā esošās obligācijas emitents	Jāaizpilda, ja pamatā esošā instrumenta veids ir obligācija vai regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums par obligāciju, norādot tiešās vai galīgās pamatā esošās obligācijas emitenta juridiskās personas identifikatora kodu (*LEI*).	{LEI}
18	Pamatā esošās obligācijas termiņš	Jāaizpilda ar pamatā esošās obligācijas noteiktā termiņa datumu.	{DATEFORMAT}
19	Pamatā esošās obligācijas emisijas datums	Jāaizpilda ar pamatā esošās obligācijas emisijas datumu	{DATEFORMAT}
20	Mijmaiņas iespējas līguma nosacītā valūta	Jāaizpilda tikai attiecībā uz mijmaiņas iespējas līgumiem.	{CURRENCYCODE_3}
21	Pamatā esošā mijmaiņas līguma termiņš	Aizpildāms tikai attiecībā uz mijmaiņas iespējas līgumiem, mijmaiņas līgumiem piesaistītiem iespējas līgumiem, mijmaiņas līgumiem piesaistītiem regulētā tirgū tirgotiem nākotnes līgumiem un mijmaiņas līgumam piesaistītiem regulētā tirgū netirgotiem nākotnes līgumiem.	{DATEFORMAT}
22	Inflācijas indeksa *ISIN* kods / pamatā esošās obligācijas *ISIN* kods	Ja mijmaiņas iespējas līgumi ir piesaistīti vienam no šādiem pamatā esošiem mijmaiņas līgumu veidiem: inflācijai piesaistīts vienas valūtas mijmaiņas līgums, regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi, kas piesaistīti inflācijai piesaistītam vienas valūtas mijmaiņas līgumam, inflācijai piesaistīti vairāku valūtu mijmaiņas līgumi, regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi, kas piesaistīti inflācijai piesaistītiem vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem; ja inflācijas indeksam ir *ISIN* kods, attiecīgais lauks jāaizpilda ar *ISIN* kodu konkrētajam indeksam. ********** Attiecībā uz obligāciju iespējas līgumu/ Obligāciju iespējas līgumam piesaistītiem iespējas līgumiem / Regulētā tirgū tirgotam obligāciju nākotnes līgumam piesaistītiem iespēju līgumiem attiecīgais lauks jāaizpilda ar galīgās pamatā esošās obligācijas *ISIN* kodu.	{ISIN} ********** {ISIN}

▼M3

23	Inflācijas indeksa nosaukums	Jāaizpilda ar standartizēto indeksa nosaukumu, ja mijmaiņas iespējas līgumi ir piesaistīti vienam no šādiem pamatā esošiem mijmaiņas līgumu veidiem: inflācijai piesaistīts vienas valūtas mijmaiņas līgums, regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi, kas piesaistīti inflācijai piesaistītam vienas valūtas mijmaiņas līgumam, inflācijai piesaistīti vairāku valūtu mijmaiņas līgumi, regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi, kas piesaistīti inflācijai piesaistītiem vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem.	{ALPHANUM-25}
24	Atsauces likme	Atsauces likmes nosaukums.	{INDEX} vai {ALPHANUM-25} – ja atsauces likme nav iekļauta {INDEX} sarakstā
25	Pamatā esošas procentu likmes termiņš	Šajā laukā ir noteikts līguma pamatā esošās procentu likmes termiņš. Termiņu izsaka dienās, nedēļās, mēnešos vai gados. Sākot ar lielāko termiņa vienību (gadi) un virzoties lejup, ja procentu likmes termiņš ir vesels skaitlis, šādu standarta termiņu aizpilda šajā laukā.	{INTEGER-3}+“DAYS” – dienas {INTEGER-3}+“WEEK” – nedēļas {INTEGER-3}+“MNTH” – mēneši {INTEGER-3}+“YEAR” – gadi

Ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti

Laukus šajā iedaļā aizpilda tikai attiecībā uz ārvalstu valūtas atvasinātajiem instrumentiem, kā definēts III pielikuma 8. iedaļas 8.1. tabulā

26	Līguma paveids	Jāaizpilda, lai nošķirtu piegādājamos un nepiegādājamos regulētā tirgū netirgotus nākotnes līgumus, iespējas līgumus un mijmaiņas līgumus, kā definēts III pielikuma 8. iedaļas 8.1. tabulā.	“DLVB” – piegādājams “NDLV” – nepiegādājams

Kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti

Laukus aizpilda tikai attiecībā uz kapitāla vērtspapīru atvasinātajiem instrumentiem, kā definēts III pielikuma 6. iedaļas 6.1. tabulā

27	Pamatā esošā instrumenta veids	Jāaizpilda, ja FITR identifikators ir atvasināts instruments, pamatā esošā instrumenta aktīvu klase ir kapitāla vērtspapīrs un aktīvu apakšklase nav ne mijmaiņas līgumi, ne portfeļa mijmaiņas līgumi.	“STIX” – akciju indekss “SHRS” – daļa/akcija “DIVI” – dividenžu indekss “DVSE” – akciju dividendes “BSKT” – korporatīvās darbības rezultātā izveidots akciju grozs “ETFS” – biržā tirgoti fondi “VOLI” – svārstīguma indekss “OTHR” – citi (tostarp depozitārie sertifikāti, sertifikāti un citi kapitāla vērtspapīru finanšu instrumentiem līdzīgi finanšu instrumenti)

▼M3

		********** Jāaizpilda, ja FITR identifikators ir atvasināts instruments, pamatā esošā instrumenta aktīvu klase ir kapitāla vērtspapīrs, aktīvu apakšklase ir vai nu mijmaiņas līgumi, vai portfeļa mijmaiņas līgumi, un 2. segmentācijas kritērijs, kā definēts III pielikuma 6. iedaļas 6.1. tabulā, ir ar vienu parādnieku saistīts līgums.	********** “SHRS” – daļa/akcija “DVSE” – akciju dividendes “ETFS” – biržā tirgoti fondi “OTHR” – citi (tostarp depozitārie sertifikāti, sertifikāti un citi kapitāla vērtspapīru finanšu instrumentiem līdzīgi finanšu instrumenti)
		********** Jāaizpilda, ja FITR identifikators ir atvasināts instruments, pamatā esošā instrumenta aktīvu klase ir kapitāla vērtspapīrs, aktīvu apakšklase ir vai nu mijmaiņas līgumi, vai portfeļa mijmaiņas līgumi un 2. segmentācijas kritērijs, kā definēts III pielikuma 6. iedaļas 6.1. tabulā, ir indekss.	********** “STIX” – akciju indekss “DIVI” – dividenžu indekss “VOLI” – svārstīguma indekss “OTHR” – citi
		********** Jāaizpilda, ja FITR identifikators ir atvasināts instruments, pamatā esošā instrumenta aktīvu klase ir kapitāla vērtspapīrs, aktīvu apakšklase ir vai nu mijmaiņas līgumi, vai portfeļa mijmaiņas līgumi un 2. segmentācijas kritērijs, kā definēts III pielikuma 6. iedaļas 6.1. tabulā, ir grozs.	********** “BSKT” – grozs
28	Parametrs	Jāaizpilda, ja FITR identifikators ir atvasināts instruments, pamatā esošā instrumenta aktīvu klase ir kapitāla vērtspapīrs un aktīvu apakšklase ir viena no šādiem variantiem: mijmaiņas līgumi, portfeļa mijmaiņas līgumi.	“PRBP” – cenas ieņēmumu darbības bāzes parametrs “PRDV” – ieņēmumu no dividendēm parametrs “PRVA” – ieņēmumu dispersijas parametrs “PRVO” – ieņēmumu svārstīguma parametrs

Līgumi par cenu starpībām

Laukus aizpilda tikai tad, ja līguma veids ir līdzvērtīgs līgumam par cenu starpībām vai starpību derībām

29	Pamatā esošā instrumenta veids	Jāaizpilda, ja FITR identifikators ir atvasinātais instruments un līguma veids ir līdzvērtīgs līgumam par cenu starpībām vai starpību derībām	“CURR” – valūta “EQUI” – kapitāla vērtspapīrs “BOND” – obligācijas “FTEQ” – kapitāla vērtspapīram piesaistīti regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi “OPEQ” – kapitāla vērtspapīram piesaistīti iespējas līgumi “COMM” – prece “EMAL” – emisijas kvotas “OTHR” – Cits

▼M3

30	Nosacītā 1. valūta	Pamatā esošo valūtu pāra 1. valūta. Lauku izmanto, ja pamatā esošais instruments ir valūta.	{CURRENCYCODE_3}
31	Nosacītā 2. valūta	Pamatā esošo valūtu pāra 2. valūta. Lauku izmanto, ja pamatā esošais instruments ir valūta.	{CURRENCYCODE_3}

Kredītu atvasinātie instrumenti

Laukus šajā iedaļā aizpilda tikai attiecībā uz kredītu atvasinātajiem instrumentiem, kā definēts III pielikuma 9. iedaļas 9.1. tabulā

32	Pamatā esošā kredītriska mijmaiņas līguma *ISIN* kods	Jāaizpilda attiecībā uz kredītriska mijmaiņas līguma atvasinātajiem instrumentiem, kam ir pamatā esošā mijmaiņas līguma *ISIN* kods.	{ISIN}
33	Pamatā esošā indeksa kods	Jāaizpilda attiecībā uz indeksa kredītriska mijmaiņas līgumu, kam ir indeksa ISIN kods.	{ISIN}
34	Pamatā esošā indeksa nosaukums	Jāaizpilda attiecībā uz indeksa kredītriska mijmaiņas līguma atvasinātajiem instrumentiem, izmantojot standartizētu indeksa nosaukumu.	{ALPHANUM-25}
35	Sērija	Indeksa satura sērijas numurs, ja piemērojams. Jāaizpilda par kredītriska mijmaiņas līguma indeksu vai kredītriska mijmaiņas līguma indeksa atvasināto instrumentu ar kredītriska mijmaiņas līguma indeksa sēriju.	{DECIMAL-18/17}
36	Versija	Jaunu sērijas versiju emitē, ja notiek viena instrumenta saistību neizpilde un indekss ir atkārtoti jāsver, lai noteiktu indeksā esošo kopējo instrumentu jauno skaitu. Jāaizpilda par kredītriska mijmaiņas līguma indeksu vai kredītriska mijmaiņas līguma indeksa atvasināto instrumentu ar kredītriska mijmaiņas līguma indeksa versiju.	{DECIMAL-18/17}
37	Pagarinājuma mēneši	Visi mēneši, kuros ir plānots pagarinājums, kā to ir noteicis indeksa sniedzējs konkrētajam gadam. Lauku atkārto katram pagarinātajam mēnesim. Jāaizpilda par kredītriska mijmaiņas līguma indeksu vai kredītriska mijmaiņas līguma indeksa atvasināto instrumentu.	“01”, “02”, “03”, “04”, “05”, “06”, “07”, “08”, “09”, “10”, “11”, “12”
38	Nākamais pagarinājuma datums	Jāaizpilda par kredītriska mijmaiņas līguma indeksu vai kredītriska mijmaiņas līguma indeksa atvasināto instrumentu ar indeksa nākamo pagarinājuma datumu, kā noteicis indeksa sniedzējs.	{DATEFORMAT}
39	Valsts un publiskā sektora emitents	Jāaizpilda, ja ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas līguma atsauces struktūra vai ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas līguma atvasinātā instrumenta atsauces struktūra ir valsts emitents, kā definēts III pielikuma 9. iedaļas 9.1. tabulā.	“TRUE” – atsauces struktūra ir valsts un publiskā sektora emitents “FALSE” – atsauces struktūra nav valsts un publiskā sektora emitents

▼M3

40	Atsauces saistība	Jāaizpilda par ar vienu parādnieku saistīta kredītriska mijmaiņas līguma atvasināto instrumentu ar atsauces saistības *ISIN* kodu.	{ISIN}
41	Atsauces struktūra	Jāaizpilda, norādot ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas līguma vai ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas līguma atvasinātā instrumenta atsauces struktūru.	{COUNTRYCODE_2} vai *ISO* 3166-2 – 2 rakstzīmju valsts kods, kam seko defise "-" un līdz pat 3 burtciparu zīmju valsts apakšiedalījuma kods vai {LEI}
42	Nosacītā valūta	Valūta, kurā ir denominēta nosacītā summa.	{CURRENCYCODE_3}

Emisiju kvotu atvasinātie instrumenti

Laukus šajā iedaļā aizpilda tikai attiecībā uz emisijas kvotu atvasinātajiem instrumentiem, kā definēts III pielikuma 13. iedaļas 13.1. tabulā

43	Emisijas kvotu atvasināto instrumentu paveids	Jāaizpilda, ja mainīgais #3 "FITR identifikators" ir "DERV"-atvasinātais instruments un mainīgais #4 "pamatā esošā instrumenta aktīvu klase" ir "EMAL"-emisijas kvota.	"CERE" – CER "ERUE" – ERU "EUAE" – EUA "EUAA" – EUAA "OTHR" – Cits

▼M3

V PIELIKUMS

Kvantitatīvie dati, kas jāsniedz pārredzamības aprēķinu nolūkā

1. tabula

2. tabulas simbolu tabula

Simbols	Datu veidi	Definīcija
{ALPHANUM-n}	Līdz n burtciparu zīmēm	Brīvas formas teksta lauks.
{ISIN}	12 burtciparu zīmes	*ISIN* kods, kā definēts *ISO* 6166.
{MIC}	4 burtciparu zīmes	Tirgus identifikators, kas definēts *ISO* 10383.
{DATEFORMAT}	Datuma formāts saskaņā ar *ISO* 8601	Datumus norāda šādā formātā: GGGG-MM-DD.
{DECIMAL-n/m}	Decimālskaitlis, kas sastāv no maksimāli n cipariem, no kuriem maksimāli m cipari var būt cipari aiz komata	Ciparu lauks gan pozitīvām, gan negatīvām vērtībām. Decimāldaļas atdala ar "." (punkts); negatīviem skaitļiem priekšā norāda "–" (mīnusa zīme). vērtības noapaļo un nesaīsina.
{INTEGER-n}	Vesels skaitlis, kas sastāv no maksimāli n cipariem	Ciparu lauks gan pozitīvām, gan negatīvām veselu skaitļu vērtībām.

2. tabula

Sīkāka informācija par datiem, kas jāsniedz, lai noteiktu likvīdu tirgu, LIS un SSTI robežvērtības finanšu instrumentiem, kas nav kapitāla vērtspapīri

#	Lauks	Uzrādāmā informācija	Izpildes vai publicēšanas vietas veids	Ziņošanas formāts un standarti
1	Instrumenta identifikācijas kods	Kods, ko izmanto finanšu instrumenta identificēšanai	Regulēts tirgus (RT) Daudzpusēja tirdzniecības sistēma (DTS) Organizēta tirdzniecības sistēma (OTS) Apstiprināta publicēšanas struktūra (APS) Konsolidētu datu lentes nodrošinātājs (KDLN)	{ISIN}
2	Izpildes datums	Datums, kurā darījumi ir izpildīti.	RT, DTS, OTS, APS, KDLN	{DATEFORMAT}

▼M3

#	Lauks	Uzrādāmā informācija	Izpildes vai publicēšanas vietas veids	Ziņošanas formāts un standarti
3	Izpildes vieta	ES tirdzniecības vietas segmenta vai sistemātiskā internalizētāja tirgus identifikācijas kods (*MIC*), ja tāds ir; pretējā gadījumā operatīvais *MIC*. Sistemātiskā internalizētāja segmenta *MIC*, ja tāds ir; pretējā gadījumā operatīvais *MIC*. *MIC* kods “XOFF” ārpusbiržas darījumiem. Attiecībā uz konkrētu *ISIN* un izpildes datumu APS vienā ierakstā summē visas ārpusbiržas tirdzniecības darbības ar attiecīgo instrumentu (*ISIN*, “XOFF”, izpildes datums).	RT, DTS, OTS, APS, KDLN	tirdzniecības vietas vai sistemātiskā internalizētāja {MIC}vai “XOFF”
4	Apturētā instrumenta karodziņš	Rādītājs par to, vai izpildes datumā attiecīgajā ekrānā instruments tika apturēts uz visu tirdzniecības dienu. Tā rezultātā 5. laukā uzrāda nulles vērtību.	RT, DTS, OTS	“TRUE” – ja instruments tika apturēts uz visu tirdzniecības dienu vai “FALSE” – ja instruments netika apturēts uz visu tirdzniecības dienu
5	Darījumu kopskaits	Kopējais izpildīto darījumu skaits izpildes datumā. Atceltos darījumus izslēdz no paziņotajiem skaitļiem. Darījumus, uz kuriem attiecas atliktā publicēšana, uzskaita apkopotajos datos, kurus nodrošinājušas tos iesniedzošās struktūras, pamatojoties uz izpildes datumu. Visos gadījumos lauks jāaizpilda ar jebkuru vērtību, kas ir lielāka par vai vienāda ar nulli. Instrumentiem, kuri ir apturēti uz visu dienu, lauks ir nulles vērtība.	RT, DTS, OTS, APS, KDLN	{INTEGER-18}
6	Kopējais apjoms	Kopējais izpildīto darījumu apjoms izpildes datumā. Apjomu mēra saskaņā ar šīs regulas II pielikuma 4. tabulu. Naudas summas norāda euro. Atceltos darījumus izslēdz no paziņotajiem skaitļiem. Darījumus, uz kuriem attiecas atliktā publicēšana, uzskaita apkopotajos datos, kurus nodrošinājušas tos iesniedzošās struktūras, pamatojoties uz izpildes datumu.	RT, DTS, OTS, APS, KDLN	{DECIMAL-18/5}

▼M3

#	Lauks	Uzrādāmā informācija	Izpildes vai publicēšanas vietas veids	Ziņošanas formāts un standarti
7	“Darījuma apjoma” intervāla diapazons	Šo lauku aizpilda ar vērtībām, kas norādītas šā pielikuma 3. un 4. tabulā. Darījuma apjoma intervāla diapazons, kā definēts: šā pielikuma 4. tabulā – emisiju kvotām un emisiju kvotu atvasinātajiem instrumentiem; šā pielikuma 3. tabulā – pārējiem instrumentiem. Attiecībā uz instrumentiem, kuri ir apturēti visu dienu, ar šo lauku un ar 8. un 9. lauku saistītos datus neuzrāda.	RT, DTS, OTS, APS, KDLN	{ALPHANUM - -140}
8	Attiecīgajam intervālam izpildīto darījumu kopskaits	Darījumu kopskaits, ko veido visi izpildes datumā izpildītie darījumi, kuru apjoms ietilpst intervāla diapazonā. Atceltos darījumus izslēdz no paziņotajiem skaitļiem. Darījumus, uz kuriem attiecas atliktā publicēšana, uzskaita apkopotajos datos, kurus nodrošinājušas tos iesniedzošās struktūras, pamatojoties uz izpildes datumu.	RT, DTS, OTS, APS, KDLN	{INTEGER-18}
9	Kopējais apjoms, kas tirgots attiecīgajā intervālā	Kopējais tirgotais apjoms, ko veido visi pārskata dienā izpildītie darījumi, kuru apjoms ietilpst intervāla diapazonā. Apjomu mēra saskaņā ar šīs regulas II pielikuma 4. tabulu. Naudas summas norāda euro. Atceltos darījumus izslēdz no paziņotajiem skaitļiem. Darījumus, uz kuriem attiecas atliktā publicēšana, uzskaita apkopotajos datos, kurus nodrošinājušas tos iesniedzošās struktūras, pamatojoties uz izpildes datumu.	RT, DTS, OTS, APS, KDLN	{DECIMAL-18/5}

▼M3

3. tabula

Tirdzniecības apjoma intervāls attiecībā uz obligācijām, strukturētā finansējuma produktiem, vērtspapīrotiem atvasinātajiem instrumentiem, procentu likmju atvasinātajiem instrumentiem, kapitāla vērtspapīru atvasinātajiem instrumentiem, ārvalstu valūtas atvasinātajiem instrumentiem, kredītu atvasinātajiem instrumentiem, preču atvasinātajiem instrumentiem, C10 atvasinātajiem instrumentiem un līgumiem par cenu starpībām

Tvērums	Darījuma intervāla apjoms	Definīcija
Darījumi, kuru apjoms ir no 0 līdz 1,000,000 (neieskaitot)	]0 – 100,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir mazāks nekā 100,000 EUR
	[100,000 – 100,000]	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir 100,000 EUR
	]100,000 – 200,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par 100,000 EUR un mazāks par 200,000 EUR
	[200,000 – 300,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 200,000 EUR un mazāks par 300,000 EUR
	[300,000 – 400,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir 300,000 EUR vai lielāks un mazāks par 400,000 EUR
	[Y– Y+ 100,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar Y EUR un mazāks par Y EUR + 100,000 (100,000 EUR posms)
	[900,000 – 1,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 900,000 EUR un mazāks par 1,000,000 EUR
Darījumi, kuru apjoms ir no 1,000,000 (ieskaitot) līdz 10,000,000 (neieskaitot)	[1,000,000 – 1,500,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 1,000,000 EUR un mazāks par 1,500,000 EUR
	[1,500,000 – 2,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 1,500,000 EUR un mazāks par 2,000,000 EUR
	[Z– Z+ 500,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar Z EUR un mazāks par Z EUR + 500,000 (500,000 EUR posms)
	[9,500,000 – 10,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 9,500,000 EUR un mazāks par 10,000,000 EUR
Darījumi, kuru apjoms ir no 10,000,000 (ieskaitot) līdz 100,000,000 (neieskaitot)	[10,000,000 – 15,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 10,000,000 EUR un mazāks par 15,000,000 EUR
	[15,000,000 – 20,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 15,000,000 EUR un mazāks par 20,000,000 EUR
	[W– W+5,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar W EUR un mazāks par W +5,000,000 EUR (5,000,000 EUR posms)
	[95,000,000 – 100,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 95,000,000 EUR un mazāks par 100,000,000 EUR
Darījumi, kuru apjoms ir 100,000,000 vai lielāks	[100,000,000 – 125,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 100,000,000 EUR un mazāks par 125,000,000 EUR
	[125,000,000 – 150,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 125,000,000 EUR un mazāks par 150,000,000 EUR
	[X– X+ 25,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar X EUR un mazāks par X +25,000,000 EUR (25,000,000 EUR posms)
…	…	…

▼M3

4. tabula

Darījumu intervāla diapazona apjoms attiecībā uz emisiju kvotām un emisiju kvotu atvasinātajiem instrumentiem

Tvērums	Darījuma intervāla apjoms	Definīcija
Darījumi, kuru apjoms ir no 0 līdz 1,000,000 (neieskaitot)	]0 – 100,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir mazāks par 100,000 tonnām oglekļa dioksīda ekvivalenta (tCO_2e)
	[100,000 – 100,000]	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir 100,000 tCO_2e
	]100,000 – 200,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par 100,000 tCO_2e un mazāks par 200,000 tCO_2e
	[200,000 – 300,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 200,000 tCO_2e un mazāks par 300,000 tCO_2e
	[300,000 – 400,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir 300,000 tCO_2e vai lielāks un mazāks par 400,000 tCO_2e
	[Y– Y+ 100,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar Y tCO_2e un mazāks par Y tCO_2e + 100,000 (100,000 tCO_2e solis)
	[900,000 – 1,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 900,000 tCO_2e un mazāks par 1,000,000 tCO_2e
Darījumi, kuru apjoms ir no 1,000,000 (ieskaitot) līdz 10,000,000 (neieskaitot)	[1,000,000 – 1,500,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 1,000,000 tCO_2e un mazāks par 1,500,000 tCO_2e
	[1,500,000 – 2,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 1,500,000 tCO_2e un mazāks par 2,000,000 tCO_2e
	[Z– Z+ 500,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar Z tCO_2e un mazāks par Z tCO_2e + 500,000 (500,000 tCO_2e solis)
	[9,500,000 – 10,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 9,500,000 tCO_2e un mazāks par 10,000,000 tCO_2e
Darījumi, kuru apjoms ir no 10,000,000 (ieskaitot) līdz 100,000,000 (neieskaitot)	[10,000,000 – 15,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 10,000,000 tCO_2e un mazāks par 15,000,000 tCO_2e
	[15,000,000 – 20,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 15,000,000 tCO_2e un mazāks par 20,000,000 tCO_2e
	[W– W+5,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar W tCO_2e un mazāks par W tCO_2e +5,000,000 (5,000,000 tCO_2e solis)
	[95,000,000 – 100,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 95,000,000 tCO_2e un mazāks par 100,000,000 tCO_2e
Darījumi, kuru apjoms ir 100,000,000 vai lielāks	[100,000,000 – 125,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 100,000,000 tCO_2e un mazāks par 125,000,000 tCO_2e
	[125,000,000 – 150,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar 125,000,000 tCO_2e un mazāks par 150,000,000 tCO_2e
	[X– X+ 25,000,000[	Darījumi, kuru tirdzniecības apjoms ir lielāks par vai vienāds ar X tCO_2e un mazāks par X tCO_2e +25,000,000 (25,000,000 tCO_2e solis)
…	…	…