Tento text slúži výlučne ako dokumentačný nástroj a nemá žiadny právny účinok. Inštitúcie Únie nenesú nijakú zodpovednosť za jeho obsah. Autentické verzie príslušných aktov vrátane ich preambúl sú tie, ktoré boli uverejnené v Úradnom vestníku Európskej únie a ktoré sú dostupné na portáli EUR-Lex. Tieto úradné znenia sú priamo dostupné prostredníctvom odkazov v tomto dokumente

►B

DELEGOVANÉ NARIADENIE KOMISIE (EÚ) 2017/583

zo 14. júla 2016,

ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 600/2014 o trhoch s finančnými nástrojmi, pokiaľ ide o regulačné technické predpisy týkajúce sa požiadaviek na transparentnosť pre obchodné miesta a investičné spoločnosti v súvislosti s dlhopismi, štruktúrovanými finančnými produktmi, emisnými kvótami a derivátmi

(Text s významom pre EHP)

(Ú. v. EÚ L 87, 31.3.2017, s. 229)

Zmenené a doplnené:

		Úradný vestník		
		Č.	Strana	Dátum
►M1	Delegované nariadenie Komisie (EÚ) 2021/529 z 18. decembra 2020	L 106	47	26.3.2021
►M2	Delegované nariadenie Komisie (EÚ) 2022/629 z 12. januára 2022	L 115I	1	13.4.2022
►M3	Delegované nariadenie Komisie (EÚ) 2023/945 zo 17. januára 2023	L 131	17	16.5.2023
►M4	Delegované nariadenie Komisie (EÚ) 2025/1246 z 18. júna 2025	L 1246	1	3.11.2025

Opravené a doplnené:

►C1 Korigendum, Ú. v. EÚ L 90102, 21.11.2023, s. 1 (2023/945)

▼B

DELEGOVANÉ NARIADENIE KOMISIE (EÚ) 2017/583

zo 14. júla 2016,

ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 600/2014 o trhoch s finančnými nástrojmi, pokiaľ ide o regulačné technické predpisy týkajúce sa požiadaviek na transparentnosť pre obchodné miesta a investičné spoločnosti v súvislosti s dlhopismi, štruktúrovanými finančnými produktmi, emisnými kvótami a derivátmi

(Text s významom pre EHP)

KAPITOLA I

VYMEDZENIE POJMOV

▼M4

Článok 1

Vymedzenie pojmov

[článok 9 ods. 5 písm. f) nariadenia (EÚ) č. 600/2014]

Na účely tohto nariadenia sa uplatňuje toto vymedzenie pojmov:

1. „systém obchodovania na základe centrálnej knihy limitovaných pokynov“ je ktorýkoľvek z týchto systémov:

   a) systém kontinuálneho obchodovania na základe knihy objednávok, ktorý pomocou knihy objednávok a algoritmu obchodovania prevádzkovaného bez zásahu človeka kontinuálne páruje pokyny na predaj s pokynmi na kúpu na základe najlepšej dostupnej ceny;

   b) systém obchodovania, v ktorom sa kombinujú prvky systému kontinuálneho obchodovania na základe knihy objednávok, ako sa uvádza v písmene a), a systému obchodovania formou periodických aukcií v zmysle vymedzenia v bode 2;

2. „systém obchodovania formou periodických aukcií“ je systém obchodovania, ktorý páruje pokyny na základe periodickej aukcie a algoritmu obchodovania prevádzkovaného bez zásahu človeka.

Článok 1a

Rozsah uplatňovania článkov 3, 6, 8, 9, 10, 11 a 13

1. Články 3, 6, 9, 10, 11 a 13 sa uplatňujú len v súvislosti s derivátmi. Článok 8 sa uplatňuje len v súvislosti s derivátmi a súbornými transakciami.

2. Odkazy na článok 11 nariadenia (EÚ) č. 600/2014, ktoré sú v článkoch 8 a 11 tohto nariadenia, sa považujú za odkazy na článok 11 nariadenia (EÚ) č. 600/2014 v znení platnom pred 28. marcom 2024.

▼B

KAPITOLA II

PREDOBCHODNÁ TRANSPARENTNOSŤ PRE REGULOVANÉ TRHY, MULTILATERÁLNE OBCHODNÉ SYSTÉMY A ORGANIZOVANÉ OBCHODNÉ SYSTÉMY

Článok 2

Povinnosti týkajúce sa predobchodnej transparentnosti

[článok 8 ods. 1 a 2 nariadenia (EÚ) č. 600/2014]

Organizátori trhu a investičné spoločnosti prevádzkujúce obchodné miesto zverejňujú rozsah nákupných a predajných cien a úroveň záujmu o obchodovanie pri týchto cenách v súlade so systémom obchodovania, ktorý prevádzkujú, a požiadavkami na informácie stanovenými v prílohe I.

Článok 3

Pokyny veľkého rozsahu

[článok 9 ods. 1 písm. a) nariadenia (EÚ) č. 600/2014]

Pokyn je veľkého rozsahu v porovnaní s bežným trhovým objemom, ak sa v čase zápisu pokynu alebo po akejkoľvek zmene pokynu rovná alebo je väčší ako minimálny objem pokynu, ktorý sa určí v súlade s metodikou stanovenou v článku 13.

▼M4

Článok 3a

Pokyny veľkého rozsahu pre dlhopisy, štruktúrované finančné produkty a emisné kvóty

[článok 9 ods. 1 písm. a) nariadenia (EÚ) č. 600/2014]

Pokyn pre dlhopisy, štruktúrované finančné produkty alebo emisné kvóty je veľkého rozsahu v porovnaní s bežným trhovým objemom, ak sa v čase zápisu alebo po akejkoľvek zmene pokynu daný pokyn rovná nasledujúcim prahovým hodnotám alebo je väčší ako nasledujúce prahové hodnoty:

a) pre všetky druhy dlhopisov okrem komodít obchodovaných na burze („ETC“) a dlhopisov obchodovaných na burze („ETN“) prahové hodnoty stanovené v tabuľke 2.3 prílohy III;

b) pre ETC a ETN prahové hodnoty stanovené v tabuľke 2.5 prílohy III;

c) pre štruktúrované finančné produkty prahové hodnoty stanovené v tabuľke 3.2 prílohy III;

d) pre emisné kvóty prahové hodnoty stanovené v tabuľke 12.2 prílohy III;

▼B

Článok 4

Druh a minimálny objem pokynov uchovávaných v systéme správy pokynov

[článok 9 ods. 1 písm. a) nariadenia (EÚ) č. 600/2014]

1. Druh pokynu, ktorý je až do zverejnenia uchovávaný v systéme správy pokynov obchodného miesta a ktorému sa môže poskytnúť výnimka z povinností týkajúcich sa predobchodnej transparentnosti, je pokyn, ktorý:

a) je určený na zverejnenie v knihe objednávok, ktorú vedie obchodné miesto, pričom je podmienený objektívnymi podmienkami, ktoré sú vopred vymedzené v protokole systému;

b) sa pred zverejnením v knihe objednávok, ktorú vedie obchodné miesto, vzájomne neovplyvňuje s iným záujmom o obchodovanie;

c) po zverejnení v knihe objednávok sa vzájomne ovplyvňuje s inými pokynmi v súlade s pravidlami uplatniteľnými pre pokyny daného druhu v čase zverejnenia.

2. Minimálnym objemom pokynov, ktoré sú až do zverejnenia uchovávané v systéme správy pokynov obchodného miesta a ktorým sa môže poskytnúť výnimka z povinností týkajúcich sa predobchodnej transparentnosti, je v čase zápisu a po akejkoľvek zmene jeden z týchto:

a) v prípade pokynu typu „reserve“ sa rovná alebo je vyšší než 10 000 EUR;

b) v prípade všetkých ďalších pokynov ide o objem vyšší než minimálne obchodovateľné množstvo alebo rovnajúci sa minimálnemu obchodovateľnému množstvu stanovenému vopred prevádzkovateľom systému podľa jeho pravidiel a protokolov.

3. Za pokyn typu „reserve“ uvedený v odseku 2 písm. a) sa považuje limitný pokyn zložený zo zverejneného pokynu vzťahujúceho sa na časť množstva a nezverejneného pokynu vzťahujúceho sa na zvyšné množstvo, pričom nezverejnené množstvo je možné vykonať len po jeho uvoľnení do knihy objednávok ako nový zverejnený pokyn.

▼M3

4. Na účely odseku 2 písm. a) sa objem pokynov uchovávaných v systéme správy pokynov meria na základe pomyselnej hodnoty obchodovaných zmlúv, ako sa uvádza v poli 10 tabuľky 2 prílohy II.

▼M4

—————

▼B

Článok 6

Triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh

[článok 9 ods. 1 písm. c) nariadenia (EÚ) č. 600/2014]

Finančný nástroj alebo trieda finančných nástrojov sa považujú za nástroje, pre ktoré neexistuje likvidný trh, ak je tak stanovené v súlade s metodikou stanovenou v článku 13.

▼M4

Článok 6a

Triedy dlhopisov, štruktúrovaných finančných produktov a emisných kvót, pre ktoré neexistuje likvidný trh

[článok 9 ods. 1 písm. c) nariadenia (EÚ) č. 600/2014)]

Na určenie toho, či sa dlhopis, štruktúrovaný finančný produkt alebo emisná kvóta majú považovať za také, pre ktoré neexistuje likvidný trh, príslušné orgány uplatňujú toto statické určenie likvidity:

a) pre všetky druhy dlhopisov okrem ETC a ETN určenie stanovené v tabuľke 2.2 prílohy III;

b) pre ETC a ETN určenie stanovené v tabuľke 2.4 prílohy III;

c) pre štruktúrované finančné produkty určenie stanovené v tabuľke 3.1 prílohy III;

d) pre emisné kvóty určenie stanovené v tabuľke 12.1 prílohy III.

▼B

KAPITOLA III

POOBCHODNÁ TRANSPARENTNOSŤ PRE OBCHODNÉ MIESTA A INVESTIČNÉ SPOLOČNOSTI OBCHODUJÚCE MIMO OBCHODNÉHO MIESTA

Článok 7

Povinnosti týkajúce sa poobchodnej transparentnosti

[článok 10 ods. 1 a článok 21 ods. 1 a 5 nariadenia (EÚ) č. 600/2014]

1. Investičné spoločnosti obchodujúce mimo rámca pravidiel obchodného miesta a organizátori trhu a investičné spoločnosti prevádzkujúce obchodné miesto zverejňujú s odkazom na každú transakciu údaje stanovené v tabuľkách 1 a 2 prílohy II a používajú všetky uplatniteľné označenia uvedené v tabuľke 3 prílohy II.

▼M4

Názvy polí stanovené v tabuľke 2 prílohy II sa zverejňujú podľa rovnakých pravidiel tvorby názvov, aké sú stanovené v identifikátore poľa uvedenej tabuľky.

▼B

2. Ak sa predtým zverejnená správa o obchode zruší, investičné spoločnosti obchodujúce mimo obchodného miesta a organizátori trhu a investičné spoločnosti prevádzkujúce obchodné miesto zverejnia novú správu o obchode, ktorá obsahuje všetky údaje z pôvodnej správy o obchode a označenie zrušenia určené v tabuľke 3 prílohy II.

3. Ak sa predtým zverejnená správa o obchode zmení, investičné spoločnosti obchodujúce mimo obchodného miesta a organizátori trhu a investičné spoločnosti prevádzkujúce obchodné miesto zverejnia tieto informácie:

a) novú správu o obchode, ktorá obsahuje všetky údaje z pôvodnej správy o obchode a označenie zrušenia určené v tabuľke 3 prílohy II;

b) novú správu o obchode, ktorá obsahuje všetky údaje z pôvodnej správy o obchode spolu s opravou všetkých potrebných údajov a s označením zmeny určeným v tabuľke 3 prílohy II;

▼M4

4. Poobchodné informácie sa sprístupnia čo najbližšie k reálnemu času, ako je technicky možné, a v každom prípade do piatich minút od vykonania príslušnej transakcie.

_____

▼B

7. Investičné spoločnosti prijímajú všetky primerané opatrenia na zabezpečenie toho, aby sa transakcia zverejnila ako jediná transakcia. Na tieto účely sa dva spárované obchody uzatvorené v rovnakom čase a za rovnakú cenu s jedinou vloženou stranou považujú za jedinú transakciu.

▼M4

8. Informácie týkajúce sa súbornej transakcie zahŕňajú označenie súbornej transakcie alebo označenie transakcie predstavujúcej výmenu za fyzické aktíva, ako sa uvádza v tabuľke 3 prílohy II. Ak je súborná transakcia oprávnená pre odklad zverejnenia podľa článku 8, informácie o všetkých zložkách sa zverejňujú po tom, ako obdobie odkladu vo vzťahu k danej transakcii uplynie.

▼B

Článok 8

Odklad zverejnenia transakcií

[článok 11 ods. 1 a 3 a článok 21 ods. 4 nariadenia (EÚ) č. 600/2014]

1. Ak príslušný orgán povolí odklad zverejnenia údajov o transakciách podľa článku 11 ods. 1 nariadenia (EÚ) č. 600/2014, investičné spoločnosti obchodujúce mimo obchodného miesta a organizátori trhu a investičné spoločnosti prevádzkujúce obchodné miesto zverejnia každú transakciu najneskôr do 19.00 hod. miestneho času druhého pracovného dňa po dátume transakcie za predpokladu, že je splnená jedna z týchto podmienok:

a) transakcia je veľkého rozsahu v porovnaní s bežným trhovým objemom, ako je stanovené v článku 9;

▼B

b) ide o transakciu s finančným nástrojom alebo triedou finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, ako je stanovené v súlade s metodikou uvedenou v článku 13;

c) transakcia sa vykonáva medzi investičnou spoločnosťou obchodujúcou na vlastný účet inak ako na základe párovania na vlastný účet podľa článku 4 ods. 1 bodu 38 smernice Európskeho parlamentu a Rady 2014/65/EÚ ([1]) a inou protistranou, pričom presahuje konkrétny objem pre daný nástroj stanovený v článku 10;

d) transakcia je súbornou transakciou, ktorá spĺňa jedno z týchto kritérií:

i) jedna alebo viacej jej zložiek sú transakciou finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh;

ii) jedna alebo viac jej zložiek sú transakcie s finančnými nástrojmi, ktoré sú veľkého rozsahu v porovnaní s bežným trhovým objemom, ako je určené v článku 9;

iii) transakcia sa vykonáva medzi investičnou spoločnosťou obchodujúcou na vlastný účet inak ako na základe párovania na vlastný účet podľa článku 4 ods. 1 bodu 38 smernice 2014/65/EÚ a inou protistranou, pričom jedna alebo viacej jej zložiek sú transakcie s finančnými nástrojmi, ktoré presahujú konkrétny objem pre daný nástroj určený v článku 10.

2. Keď časový limit odkladu stanovený v odseku 1 uplynie, zverejnia sa všetky údaje o transakcii, ak nebolo poskytnuté predĺžené alebo neobmedzené časové obdobie odkladu v súlade s článkom 11.

3. Ak sa transakcia medzi dvomi investičnými spoločnosťami, či už na vlastný účet alebo v mene klientov, vykonáva mimo rámca pravidiel obchodného miesta, dotknutým príslušným orgánom na účely určenia uplatniteľného režimu odkladu je príslušný orgán investičnej spoločnosti zodpovednej za zverejnenie obchodu prostredníctvom APA v súlade s článkom 7 ods. 5, 6 a 7.

▼M4

Článok 8a

Odklad zverejnenia transakcií s dlhopismi, štruktúrovanými finančnými produktmi a emisnými kvótami

[článok 11 nariadenia (EÚ) č. 600/2014]

1. Organizátori trhu a investičné spoločnosti prevádzkujúce obchodné miesto a investičné spoločnosti obchodujúce mimo obchodného miesta môžu odložiť zverejnenie podrobných údajov o transakciách týkajúcich sa dlhopisov s výnimkou ETC a ETN v súlade s týmito pravidlami:

([1]) Smernica Európskeho parlamentu a Rady 2014/65/EÚ z 15. mája 2014 o trhoch s finančnými nástrojmi, ktorou sa mení smernica 2002/92/ES a smernica 2011/61/EÚ (Ú. v. EÚ L 173, 12.6.2014, s. 349).

▼M4

a) odklad zverejnenia ceny a odklad zverejnenia objemu nepresahujúci 15 minút v prípade transakcií v kategórii 1, ako sa uvádza v tabuľke 2.6 prílohy III;

b) odklad zverejnenia ceny a odklad zverejnenia objemu nepresahujúci koniec obchodného dňa v prípade transakcií v kategórii 2, ako sa uvádza v tabuľke 2.6 prílohy III;

c) odklad zverejnenia ceny nepresahujúci koniec prvého obchodného dňa od uskutočnenia transakcie a odklad zverejnenia objemu nepresahujúci jeden týždeň od uskutočnenia transakcie v prípade transakcií v kategórii 3, ako sa uvádza v tabuľke 2.6 prílohy III;

d) odklad zverejnenia ceny nepresahujúci koniec druhého obchodného dňa od uskutočnenia transakcie a odklad zverejnenia objemu nepresahujúci dva týždne od uskutočnenia transakcie v prípade transakcií v kategórii 4, ako sa uvádza v tabuľke 2.6 prílohy III;

e) odklad zverejnenia ceny a odklad zverejnenia objemu nepresahujúci štyri týždne od uskutočnenia transakcie v prípade transakcií v kategórii 5, ako sa uvádza v tabuľke 2.6 prílohy III;

2. Organizátori trhu a investičné spoločnosti prevádzkujúce obchodné miesto a investičné spoločnosti obchodujúce mimo obchodného miesta môžu odložiť zverejnenie podrobných údajov o transakciách týkajúcich sa ETC, ETN a štruktúrovaných finančných produktov v súlade s týmito pravidlami:

a) odklad zverejnenia ceny nepresahujúci koniec druhého obchodného dňa od uskutočnenia transakcie v prípade transakcií každej veľkosti a

b) odklad zverejnenia objemu nepresahujúci dva týždne od uskutočnenia transakcie v prípade transakcií každej veľkosti.

3. Organizátori trhu a investičné spoločnosti prevádzkujúce obchodné miesto a investičné spoločnosti obchodujúce mimo obchodného miesta zverejnia každú transakciu v súvislosti s emisnými kvótami najneskôr do 19.00 hod. miestneho času druhého pracovného dňa od uskutočnenia transakcie za predpokladu, že transakcia presahuje poobchodný objem pre emisné kvóty, ako sa uvádza v tabuľke 12.2 prílohy III.

▼B

Článok 9

Transakcie veľkého rozsahu

[článok 11 ods. 1 písm. a) nariadenia (EÚ) č. 600/2014]

Transakcia sa považuje za transakciu veľkého rozsahu v porovnaní s bežným trhovým objemom, ak sa rovná alebo je väčšia než minimálny objem transakcie, ktorý sa vypočítava v súlade s metodikou stanovenou v článku 13.

▼B

Článok 10

Objem špecifický pre daný finančný nástroj

[článok 11 ods. 1 písm. c) nariadenia (EÚ) č. 600/2014]

Transakcia sa považuje za transakciu presahujúcu objem špecifický pre daný finančný nástroj, ak sa rovná alebo je väčšia než minimálny objem transakcie, ktorý sa vypočítava v súlade s metodikou stanovenou v článku 13.

Článok 11

Požiadavky na transparentnosť v spojení s odkladom zverejnenia podľa voľného uváženia príslušných orgánov

[článok 11 ods. 3 nariadenia (EÚ) č. 600/2014]

1. Ak príslušné orgány vykonávajú svoje právomoci v spojení s povolením odkladu zverejnenia podľa článku 11 ods. 3 nariadenia (EÚ) č. 600/2014, uplatňuje sa nasledovné:

a) ak sa uplatňuje článok 11 ods. 3 písm. a) nariadenia (EÚ) č. 600/2014, príslušné orgány vyžadujú zverejnenie niektorých z týchto informácií počas celého obdobia odkladu, ako je uvedené v článku 8:

   i) všetky údaje o transakcii stanovené v tabuľkách 1 a 2 prílohy II s výnimkou údajov týkajúcich sa objemu;

   ii) pri minimálnom počte 5 transakcií vykonaných v rovnaký deň sa transakcie zverejnia v dennej súhrnnej podobe nasledujúci pracovný deň pred 09.00 hod. miestneho času.

b) ak sa uplatňuje článok 11 ods. 3 písm. b) nariadenia (EÚ) č. 600/2014, príslušné orgány umožnia nezverejnenie objemu jednotlivých transakcií počas predĺženého obdobia štyroch týždňov.

c) pokiaľ ide o nekapitálové nástroje, ktoré nie sú štátnymi dlhovými nástrojmi, a ak sa uplatňuje článok 11 ods. 3 písm. c) nariadenia (EÚ) č. 600/2014, príslušné orgány umožnia počas predĺženého obdobia odkladu štyroch týždňov zverejnenie niekoľkých transakcií vykonaných počas jedného kalendárneho týždňa v súhrnnej podobe nasledujúci utorok pred 09.00 hod. miestneho času.

▼M4

_____

▼B

2. Ak predĺžené obdobie odkladu stanovené v odseku 1 písm. b) uplynulo, uplatňujú sa tieto požiadavky:

a) pokiaľ ide o všetky nástroje, ktoré nie sú štátnymi dlhovými nástrojmi, zverejnenie úplných údajov o všetkých jednotlivých transakciách, a to nasledujúci pracovný deň pred 09.00 hod. miestneho času.

▼M4

_____

▼B

3. Pokiaľ ide o všetky nástroje, ktoré nie sú štátnymi dlhovými nástrojmi, všetky údaje o jednotlivých transakciách sa zverejňujú štyri týždne po zverejnení súhrnných údajov v súlade s odsekom 1 písm. c) pred 09.00 hod. miestneho času.

▼M4

4. Súhrnné denné alebo týždenné údaje uvedené v odsekoch 1 a 2 musia zahŕňať nasledujúce informácie o derivátoch, a to vo vzťahu ku každému dňu alebo týždňu príslušného kalendárneho obdobia:

a) váženú priemernú cenu;

b) celkový obchodovaný objem, ako je uvedené v tabuľke 4 prílohy II;

c) celkový počet transakcií.

▼B

5. Súhrny transakcií sa tvoria na základe kódu ISIN. Ak kód ISIN nie je k dispozícii, súhrny transakcií sa tvoria na úrovni triedy finančných nástrojov, na ktoré sa vzťahuje test likvidity stanovený v článku 13.

▼M4

6. Ak deň určený na zverejnenie stanovený v odseku 1 písm. c) a odsekoch 2 a 3 nie je pracovným dňom, zverejnenie sa uskutoční nasledujúci pracovný deň pred 09.00 hod. miestneho času.

Článok 11a

Požiadavky na transparentnosť v prípade štátnych dlhových nástrojov v spojení s odkladom zverejnenia podľa voľného uváženia príslušných orgánov

[článok 11 ods. 3 nariadenia (EÚ) č. 600/2014]

1. Zverejnenie podrobných údajov o viacerých transakciách v súhrnnej podobe, ako sa uvádza v článku 11 ods. 3 písm. b) nariadenia (EÚ) č. 600/2014, sa vzťahuje na transakcie, ktoré boli vykonané v priebehu jedného kalendárneho týždňa, a uskutoční sa nasledujúci utorok pred 09.00 hod. miestneho času.

2. Súhrnné týždenné údaje uvedené v odseku 1 musia zahŕňať nasledujúce informácie, a to vo vzťahu ku každému týždňu príslušného kalendárneho obdobia:

a) váženú priemernú cenu;

b) celkový obchodovaný objem, ako je uvedené v tabuľke 4 prílohy II;

c) celkový počet transakcií.

3. Súhrny transakcií sa tvoria na základe kódu ISIN.

4. Ak deň určený na zverejnenie stanovený v odseku 1 nie je pracovným dňom, zverejnenie sa uskutoční nasledujúci pracovný deň pred 09.00 hod. miestneho času.

▼M3

Článok 12

Uplatnenie poobchodnej transparentnosti na určité transakcie vykonané mimo obchodného miesta

[článok 21 ods. 1 nariadenia (EÚ) č. 600/2014]

Povinnosti stanovené v článku 21 ods. 1 nariadenia (EÚ) č. 600/2014 sa neuplatňujú na transakcie uvedené v článku 2 ods. 5 delegovaného nariadenia Komisie (EÚ) 2017/590 ([1]).

▼B

KAPITOLA IV

SPOLOČNÉ USTANOVENIA PRE PREDOBCHODNÚ A POOBCHODNÚ TRANSPARENTNOSŤ

Článok 13

Metodika vykonávania výpočtov transparentnosti

[článok 9 ods. 1 a 2, článok 11 ods. 1 a článok 22 ods. 1 nariadenia (EÚ) č. 600/2014]

1. Na určenie finančných nástrojov alebo tried finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh na účely článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), sa použijú naprieč triedami aktív tieto metodiky:

a) Statické určenie likvidity pre:

i) triedu aktív sekuritizovaných derivátov podľa vymedzenia v tabuľke 4.1 prílohy III;

ii) tieto podtriedy aktív akciových derivátov: opcie na akciový index, futures/forwardy na akciový index, akciové opcie, akciové futures/forwardy, opcie na dividendy akcie, futures/forwardy na dividendy akcie, opcie na dividendový index, futures/forwardy na dividendový index, opcie na index volatility, futures/forwardy na index volatility, opcie na ETF, futures/forwardy na ETF a iné akciové deriváty podľa vymedzenia v tabuľke 6.1 prílohy III;

iii) triedu aktív devízových derivátov podľa vymedzenia v tabuľke 8.1 prílohy III;

▼M4

iv) podtriedy aktív iných úrokových derivátov, iných komoditných derivátov, iných kreditných derivátov, iných derivátov C10, iných rozdielových zmlúv a iných derivátov na emisné kvóty, ako sa uvádza v tabuľkách 5.1, 7.1, 9.1, 10.1, 11.1 a 13.1 prílohy III;

([1]) Delegované nariadenie Komisie (EÚ) 2017/590 z 28. júla 2016, ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 600/2014, pokiaľ ide o regulačné technické predpisy týkajúce sa oznamovania transakcií príslušným orgánom (Ú. v. EÚ L 87, 31.3.2017, s. 449).

▼B

b) pravidelné posúdenie založené na kvantitatívnych a prípadne kvalitatívnych kritériách likvidity pre:

▼M4

_____

▼B

iii) triedu aktív úrokových derivátov s výnimkou podtriedy aktív iných úrokových derivátov podľa vymedzenia v tabuľke 5.1 prílohy III;

iv) tieto podtriedy aktív akciových derivátov: swapy a portfóliové swapy podľa vymedzenia v tabuľke 6.1 prílohy III;

v) triedu aktív komoditných derivátov s výnimkou podtriedy aktív iných komoditných derivátov podľa vymedzenia v tabuľke 7.1 prílohy III;

vi) tieto podtriedy aktív kreditných derivátov: indexové swapy na kreditné zlyhanie a swapy na kreditné zlyhanie zmierňujúce kreditné riziko len jednej protistrany podľa vymedzenia v tabuľke 9.1 prílohy III;

vii) triedu aktív derivátov C10 s výnimkou podtriedy aktív iných derivátov C10 podľa vymedzenia v tabuľke 10.1 prílohy III;

viii) tieto podtriedy aktív rozdielových zmlúv: menové rozdielové zmluvy a komoditné rozdielové zmluvy podľa vymedzenia v tabuľke 11.1 prílohy III;

▼M4

_____

▼B

x) triedu aktív derivátov na emisné kvóty s výnimkou podtriedy aktív iných derivátov na emisné kvóty podľa vymedzenia v tabuľke 13.1 prílohy III.

c) Pravidelné posúdenie založené na kvalitatívnych kritériách likvidity pre:

i) tieto podtriedy aktív kreditných derivátov: opcie na index CDS a opcie na swap na kreditné zlyhanie zmierňujúci kreditné riziko len jednej protistrany podľa vymedzenia v tabuľke 9.1 prílohy III;

ii) tieto podtriedy aktív rozdielových zmlúv: akciové rozdielové zmluvy, dlhopisové rozdielové zmluvy, rozdielové zmluvy na akciové futures/forwardy a rozdielové zmluvy na opciu na akcie podľa vymedzenia v tabuľke 11.1 prílohy III.

▼M4

_____

▼B

2. ►M4 Na určenie pokynov veľkého rozsahu v porovnaní s bežným trhovým objemom, ako sa uvádza v článku 3, sa používajú tieto metodiky: ◄

a) prahová hodnota pre:

▼M4

_____

▼B

ii) triedu aktív sekuritizovaných derivátov podľa vymedzenia v tabuľke 4.2 prílohy III;

iii) každú podtriedu akciových derivátov podľa vymedzenia v tabuľkách 6.2 a 6.3 prílohy III;

iv) každú podtriedu devízových derivátov podľa vymedzenia v tabuľke 8.2 prílohy III;

v) každú podtriedu, ktorá sa považuje za podtriedu, pre ktorú neexistuje likvidný trh pre triedy aktív úrokových derivátov, komoditných derivátov, kreditných derivátov, derivátov C10 a rozdielových zmlúv podľa vymedzenia v tabuľkách 5.3, 7.3, 9.3, 10.3 a 11.3 prílohy III;

▼M4

vi) každú podtriedu aktív, ktorá sa považuje za podtriedu, pre ktorú neexistuje likvidný trh pre triedy aktív derivátov na emisné kvóty, ako sa uvádza v tabuľke 13.3 prílohy III.

_____

▼B

b) ►M4 vyššia z týchto hodnôt: objem obchodu, pod ktorým leží percento transakcií zodpovedajúce obchodnému percentilu, a spodná prahová hodnota pre: ◄

▼M4

_____

▼B

ii) každú podtriedu s likvidným trhom pre triedy aktív úrokových derivátov, komoditných derivátov, kreditných derivátov, derivátov C10 a rozdielových zmlúv podľa vymedzenia v tabuľkách 5.2, 7.2, 9.2, 10.2 a 11.2 prílohy III;

▼M4

iii) každú podtriedu aktív, pre ktorú existuje likvidný trh pre triedy aktív derivátov na emisné kvóty, ako sa uvádza v tabuľke 13.2 prílohy III;

_____

▼B

3. Na určenie objemu špecifického pre daný finančný nástroj uvedeného v článku 8 ods. 1 písm. c) a transakcií veľkého rozsahu v porovnaní s bežným trhovým objemom uvedených v článku 8 ods. 1 písm. a) sa používajú tieto metodiky:

a) prahová hodnota pre:

▼M4

_____

▼B

ii) triedu aktív sekuritizovaných derivátov podľa vymedzenia v tabuľke 4.2 prílohy III;

iii) každú podtriedu akciových derivátov podľa vymedzenia v tabuľkách 6.2 a 6.3 prílohy III;

iv) každú podtriedu devízových derivátov podľa vymedzenia v tabuľke 8.2 prílohy III;

v) každú podtriedu, ktorá sa považuje za podtriedu, pre ktorú neexistuje likvidný trh pre triedy aktív úrokových derivátov, komoditných derivátov, kreditných derivátov, derivátov C10 a rozdielových zmlúv podľa vymedzenia v tabuľkách 5.3, 7.3, 9.3, 10.3, 11.3 prílohy III;

▼M4

vi) každú podtriedu aktív, ktorá sa považuje za podtriedu, pre ktorú neexistuje likvidný trh pre triedu aktív derivátov na emisné kvóty, ako sa uvádza v tabuľke 13.3 prílohy III;

_____

_____

▼B

c) najvyššia z týchto hodnôt: objem obchodu, pod ktorým leží percento transakcií zodpovedajúce obchodnému percentilu, objem obchodu, pod ktorým leží percento objemu zodpovedajúce objemovému percentilu, a spodná prahová hodnota pre každú podtriedu považovanú za majúcu likvidný trh pre triedy aktív úrokových derivátov, komoditných derivátov, kreditných derivátov, derivátov C10 a rozdielových zmlúv, ako je stanovené v tabuľkách 5.2, 7.2, 9.2, 10.2 a 11.2 prílohy III;

▼M4

d) vyššia z týchto hodnôt: objem obchodu, pod ktorým leží percento transakcií zodpovedajúce obchodnému percentilu, a spodná prahová hodnota pre každú podtriedu aktív, ktorá sa považuje za podtriedu, pre ktorú existuje likvidný trh pre deriváty na emisné kvóty, ako sa stanovuje v tabuľke 13.2 prílohy III.

▼B

4. Na účely odseku 3 písm. c) v prípade, ak objem obchodu zodpovedajúci objemovému percentilu na určenie transakcie, ktorá je veľkého rozsahu v porovnaní s bežným trhovým objemom, je vyšší než 97,5 obchodného percentilu, objem obchodu sa nezohľadňuje, a objem špecifický pre daný finančný nástroj uvedený v článku 8 ods. 1 písm. c) a objem transakcií veľkého rozsahu v porovnaní s bežným trhovým objemom uvedený v článku 8 ods. 1 písm. a) sa určujú ako vyššia z týchto hodnôt: objem obchodu, pod ktorým leží percento transakcií zodpovedajúce obchodnému percentilu, a spodná prahová hodnota.

▼B

5. V súlade s delegovaným nariadením (EÚ) 2017/590 a (EÚ) 2017/577 príslušné orgány zhromažďujú denne údaje z obchodných miest, APA a CTP, ktoré sú potrebné na vykonanie výpočtov s cieľom určiť:

a) finančné nástroje a triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, ako je uvedené v odseku 1;

▼M4

b) objemy veľkého rozsahu v porovnaní s bežným trhovým objemom a objem špecifický pre daný nástroj, ako sa stanovuje v odseku 3.

▼M3

Údaje uvedené v prvom pododseku sa zhromažďujú v súlade s prílohou V.

▼B

6. Príslušné orgány vykonávajúce výpočty pre triedu finančných nástrojov medzi sebou uzatvoria dohody o spolupráci s cieľom zabezpečiť vytvorenie súhrnu údajov v celej Únii nevyhnutných na vykonanie výpočtov.

▼M4

7. Na účely odseku 1 písm. b), odseku 2 písm. b) a odseku 3 písm. c) a d) príslušné orgány zohľadňujú transakcie vykonané v Únii v období medzi 1. januárom a 31. decembrom predchádzajúceho roka.

8. Objem obchodu na účely odseku 2 písm. b) a odseku 3 písm. c) a d) sa určuje na základe miery objemu, ako sa stanovuje v tabuľke 4 prílohy II. Ak je objem obchodu stanovený na účely odsekov 2 a 3 vyjadrený v peňažnej hodnote a finančný nástroj nie je denominovaný v eurách, objem obchodu sa prevedie na menu, v ktorej je daný finančný nástroj denominovaný, a to použitím referenčného výmenného kurzu eura Európskej centrálnej banky k 31. decembru predchádzajúceho roka.

▼B

9. Organizátori trhu a investičné spoločnosti prevádzkujúce obchodné miesto môžu previesť objemy obchodov určené podľa odsekov 2 a 3 na zodpovedajúci počet lotov vopred definovaných daným obchodným miestom pre príslušnú podtriedu alebo podtriedu aktív. Organizátori trhu a investičné spoločnosti prevádzkujúce obchodné miesto môžu zachovať takéto objemy obchodov až do použitia výsledkov nasledujúcich výpočtov vykonaných v súlade s odsekom 17.

▼M4

_____

11. Na účely určenia podľa odsekov 2 a 3 sa odsek 2 písm. b) a odsek 3 písm. c) a d) neuplatňujú, keď je počet transakcií zohľadnených pri výpočtoch menší ako 1 000. V takýchto prípadoch sa namiesto toho uplatňujú prahové hodnoty stanovené v odseku 2 písm. a) a odseku 3 písm. a).

▼B

12. ►M4 S výnimkou odkazov na deriváty na emisné kvóty sa výpočty uvedené v odseku 2 písm. b) a odseku 3 písm. c) zaokrúhľujú nahor na najbližších: ◄

a) 100 000, ak je prahová hodnota nižšia ako 1 milión;

b) 500 000, ak sa prahová hodnota rovná alebo je vyššia ako 1 milión, ale nižšia ako 10 miliónov;

c) 5 miliónov, ak sa prahová hodnota rovná alebo je vyššia ako 10 miliónov, ale nižšia ako 100 miliónov;

d) 25 miliónov, ak sa prahová hodnota rovná alebo je vyššia ako 100 miliónov.

13. Na účely odseku 1 sa kvantitatívne kritériá likvidity stanovené pre každú triedu aktív v prílohe III určujú podľa oddielu 1 prílohy III.

▼M4

14. Pre akciové deriváty, ktoré sú prijaté na obchodovanie alebo prvýkrát obchodované na obchodnom mieste, ktoré nepatria do podtriedy, pre ktorú bol objem špecifický pre daný finančný nástroj uvedený v článku 8 ods. 1 písm. c) a objem pokynov a transakcií veľkého rozsahu v porovnaní s bežným trhovým objemom podľa článku 3 a článku 8 ods. 1 písm. a) zverejnený, a ktoré patria do jednej z podtried aktív stanovených v odseku 1 písm. a) bode ii), je objem špecifický pre daný finančný nástroj a objem pokynov a transakcií veľkého rozsahu v porovnaní s bežným trhovým objemom taký, ktorý sa vzťahuje na pásmo podtriedy aktív s najmenšou priemernou dennou pomyselnou hodnotou, do ktorej akciový derivát patrí.

15. Finančné nástroje prijaté na obchodovanie alebo prvýkrát obchodované na obchodnom mieste, ktoré nepatria do žiadnej podtriedy, pre ktorú bol zverejnený objem špecifický pre daný finančný nástroj uvedený v článku 8 ods. 1 písm. c) a objem pokynov a transakcií veľkého rozsahu v porovnaní s bežným trhovým objemom podľa článku 3 a článku 8 ods. 1 písm. a), sa považujú za finančné nástroje, pre ktoré neexistuje likvidný trh, až do použitia výsledkov výpočtov vykonaných v súlade s odsekom 17. Uplatniteľným objemom špecifickým pre daný finančný nástroj uvedeným v článku 8 ods. 1 písm. c) a objemom pokynov a transakcií veľkého rozsahu v porovnaní s bežným trhovým objemom podľa článku 3 a článku 8 ods. 1 písm. a) je ten, ktorý sa vzťahuje na podtriedy, pri ktorých sa určilo, že pre ne neexistuje likvidný trh, ktoré patria do rovnakej podtriedy aktív.

▼B

16. Po skončení obchodného dňa, ale pred koncom daného dňa, predložia obchodné miesta príslušným orgánom údaje uvedené v prílohe IV na vykonanie výpočtov uvedených v odseku 5 vždy, keď je finančný nástroj prijatý na obchodovanie alebo prvýkrát obchodovaný na danom obchodnom mieste alebo vždy, keď dôjde k zmene skôr poskytnutých údajov.

▼M3

17. Príslušné orgány musia zabezpečiť zverejnenie výsledkov výpočtov uvedených v odseku 5 pre každý finančný nástroj a triedu finančného nástroja do 30. apríla roka nasledujúceho po dátume začatia uplatňovania nariadenia (EÚ) č. 600/2014 a potom každý rok do 30. apríla. Výsledky výpočtov sa použijú od prvého júnového pondelka každého roka nasledujúceho po zverejnení až do dňa pred prvým júnovým pondelkom nasledujúceho roka.

▼M4

_____

▼B

Článok 14

Transakcie, na ktoré sa vzťahuje výnimka podľa článku 1 ods. 6 nariadenia (EÚ) č. 600/2014

[článok 1 ods. 6 nariadenia (EÚ) č. 600/2014]

Transakcia sa považuje za uzatvorenú členom Európskeho systému centrálnych bánk (ESCB) pri vykonávaní menovej a kurzovej politiky a politiky súvisiacej s finančnou stabilitou, ak daná transakcia spĺňa niektorú z týchto požiadaviek:

a) transakcia sa vykonáva na účely menovej politiky vrátane operácie uskutočnenej v súlade s článkami 18 a 20 Štatútu Európskeho systému centrálnych bánk a Európskej centrálnej banky pripojeného k Zmluve o Európskej únii alebo operácie uskutočnenej podľa zodpovedajúcich vnútroštátnych ustanovení pre členov ESCB v členských štátoch, ktorých menou nie je euro;

b) transakcia je devízovou operáciou vrátane operácií vykonávaných na účely držania alebo správy oficiálnych devízových rezerv členských štátov alebo služby v oblasti správy rezerv, ktorú poskytuje člen ESCB centrálnym bankám v iných krajinách, na ktoré bola výnimka predĺžená v súlade s článkom 1 ods. 9 nariadenia (EÚ) č. 600/2014;

c) transakcia sa vykonáva na účely politiky súvisiacej s finančnou stabilitou.

Článok 15

Transakcie, na ktoré sa nevzťahuje výnimka podľa článku 1 ods. 6 nariadenia (EÚ) č. 600/2014

[článok 1 ods. 7 nariadenia (EÚ) č. 600/2014]

Článok 1 ods. 6 nariadenia (EÚ) č. 600/2014 sa nevzťahuje na nasledujúce druhy transakcií uskutočnených členom ESCB na vykonávanie investičnej operácie, ktorá nesúvisí s vykonávaním jednej z úloh uvedených v článku 14 týmto členom:

a) transakcie uskutočnené na spravovanie jeho vlastných zdrojov;

▼B

b) transakcie uskutočnené pre potreby prevádzky alebo pre zamestnancov člena ESCB, ktoré zahŕňajú transakcie vykonávané správcom dôchodkového systému pre svojich zamestnancov;

c) transakcie uskutočnené pre vlastné investičné portfólio na základe povinností podľa vnútroštátneho práva.

▼M4

Článok 16

Dočasné pozastavenie povinností týkajúcich sa transparentnosti

[článok 9 ods. 4 nariadenia (EÚ) č. 600/2014]

1. V prípade finančných nástrojov, pre ktoré existuje likvidný trh určený na základe metodiky stanovenej v článku 6a pre dlhopisy, štruktúrované finančné produkty a emisné kvóty a v článku 13 pre deriváty, môžu príslušné orgány dočasne pozastaviť povinnosti stanovené v článkoch 8, 8a a 10 nariadenia (EÚ) č. 600/2014, ak pre triedu dlhopisov, štruktúrovaných finančných produktov, emisných kvót alebo derivátov celkový objem, ako je uvedený v tabuľke 4 prílohy II, vypočítaný za predchádzajúcich 30 kalendárnych dní, predstavuje menej ako 40 % priemerného mesačného objemu vypočítaného za 12 celých kalendárnych mesiacov predchádzajúcich uvedeným 30 kalendárnym dňom.

2. V prípade finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh určený na základe metodiky stanovenej v článku 6a pre dlhopisy, štruktúrované finančné produkty a emisné kvóty a v článku 13 pre deriváty, môžu príslušné orgány dočasne pozastaviť povinnosti uvedené v článkoch 8, 8a a 10 nariadenia (EÚ) č. 600/2014, ak pre triedu dlhopisov, štruktúrovaných finančných produktov, emisných kvót alebo derivátov celkový objem, ako je uvedený v tabuľke 4 prílohy II, vypočítaný za predchádzajúcich 30 kalendárnych dní, predstavuje menej ako 20 % priemerného mesačného objemu vypočítaného za 12 celých kalendárnych mesiacov predchádzajúcich uvedeným 30 kalendárnym dňom.

3. Príslušné orgány zohľadňujú pri vykonávaní výpočtov uvedených v odsekoch 1 a 2 transakcie vykonané na všetkých miestach v Únii pre dotknutú triedu dlhopisov, štruktúrovaných finančných produktov, emisných kvót alebo derivátov. Príslušné orgány vykonávajú tieto výpočty na úrovni triedy finančných nástrojov, na ktorú sa uplatňuje test likvidity stanovený v článku 6a pre dlhopisy, štruktúrované finančné produkty a emisné kvóty a v článku 13 pre deriváty.

4. Pred tým, ako príslušné orgány pozastavia povinností týkajúce sa transparentnosti, overia, že významný pokles likvidity naprieč všetkými miestami nie je výsledkom sezónnych vplyvov príslušnej triedy finančných nástrojov na likviditu.

▼B

Článok 19

Nadobudnutie účinnosti a uplatňovanie

Toto nariadenie nadobúda účinnosť dvadsiatym dňom po jeho uverejnení v *Úradnom vestníku Európskej únie*.

Uplatňuje sa od 3. januára 2018. Článok 18 sa však uplatňuje od dátumu nadobudnutia účinnosti tohto nariadenia.

Toto nariadenie je záväzné v celom rozsahu a priamo uplatniteľné vo všetkých členských štátoch.

▼M4

PRÍLOHA I

Druhy systému a súvisiace informácie, ktoré sa majú zverejniť v súlade s článkom 2

Druh systému	Informácie, ktoré sa majú zverejniť
Systém kontinuálneho obchodovania na základe knihy objednávok	Pre každý finančný nástroj súhrnný počet pokynov a objem, ktorý tieto pokyny predstavujú, v každej cenovej hladine, a to pre minimálne päť najlepších cenových hladín ponúk na nákup a predaj.
Systém obchodovania formou periodických aukcií	Pre každý finančný nástroj cena, za ktorú by systém obchodovania formou aukcie najlepšie vyhovel algoritmu obchodovania systému, a objem, ktorý by potenciálne bol pri tejto cene v danom systéme vykonateľný účastníkmi.

▼B

PRÍLOHA II

Údaje o transakciách, ktoré sa majú zverejniť

Tabuľka 1

Tabuľka symbolov pre tabuľku 2

SYMBOL	DRUH ÚDAJOV	VYMEDZENIE
{ALPHANUM-n}	Až n alfanumerických znakov	Pole s voľným textom.
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerické znaky	3-miestny kód meny podľa ISO 4217 pre kódy mien
{DATE_TIME_FORMAT}	Formát dátumu a času podľa ISO 8601	Dátum a čas v tomto formáte: RRRR-MM-DDThh:mm:s.dddddd Z. Kde: — „RRRR“ je rok, — „MM“ je mesiac, — „DD“ je deň, — „T“ – znamená, že sa použije písmeno „T“, — „hh“ je hodina, — „mm“ je minúta, — „s.dddddd“ je sekunda a jej zlomok, — Z je UTC čas. Dátumy a časy sa uvádzajú v UTC.
{DECIMAL-n/m}	Desatinné číslo v celkovom rozsahu až n číslic, z toho až m číslic môžu byť zlomkové číslice	Numerické pole pre kladné aj záporné hodnoty: — oddeľovač desatinných miest je „.“ (bodka), — pred zápornými číslami sa uvádza znamienko „–“ (mínus). Hodnoty musia byť v prípade potreby zaokrúhlené, nie však skrátené.
{ISIN}	12 alfanumerických znakov	Kód ISIN podľa ISO 6166
{MIC}	4 alfanumerické znaky	Identifikátor trhu podľa vymedzenia v ISO 10383

▼M4

Tabuľka 2

Zoznam údajov na účely poobchodnej transparentnosti

Uverejnené názvy polí (hlavičky stĺpcov) musia byť totožné s identifikátorom poľa uvedeným v tabuľke 2.

#	Identifikátor poľa	Finančné nástroje	Opis a údaje, ktoré sa majú uverejniť	Druh miesta vykonania alebo zverejnenia	Formát, ktorý sa má vyplniť, ako sa uvádza v tabuľke 1
1	Dátum a čas obchodovania	Pre všetky finančné nástroje	Dátum a čas, kedy bola transakcia vykonaná. V prípade transakcií vykonaných na obchodnom mieste musí byť miera podrobnosti v súlade s požiadavkami stanovenými v článku 12 delegovaného nariadenia Komisie (EÚ) 2025/1155 ([1]). V prípade transakcií nevykonaných na obchodnom mieste dátum a čas musí byť ten, kedy sa strany dohodli na obsahu týchto polí: množstvo, cena, meny, ako sa stanovuje v poliach 31, 34 a 44 tabuľky 2 prílohy I k delegovanému nariadeniu (EÚ) 2017/590, identifikačný kód nástroja, klasifikácia nástroja a kód podkladového nástroja, ak sa uplatňuje. V prípade transakcií nevykonaných na obchodnom mieste sa čas uvádza s presnosťou aspoň na najbližšiu sekundu. Ak je transakcia výsledkom pokynu, ktorý vykonávajúca spoločnosť postúpila v mene klienta tretej strane, pričom podmienky postúpenia stanovené v článku 4 delegovaného nariadenia (EÚ) 2017/590 neboli splnené, uvádza sa dátum a čas transakcie a nie čas postúpenia pokynu.	regulovaný trh (RM) multilaterálny obchodný systém (MTF) organizovaný obchodný systém (OTF) schválený mechanizmus zverejňovania (APA)	{DATE_TIME_ FORMAT}
2	Identifikačný kód nástroja	Pre všetky finančné nástroje	Kód používaný na identifikáciu finančného nástroja	RM, MTF, OTF, APA	{ISIN}

▼M4

#	Identifikátor poľa	Finančné nástroje	Opis a údaje, ktoré sa majú uverejniť	Druh miesta vykonania alebo zverejnenia	Formát, ktorý sa má vyplniť, ako sa uvádza v tabuľke 1
3	Cena	Pre všetky finančné nástroje	Obchodovaná cena transakcie bez prípadnej provízie a vzniknutého úroku. Obchodovaná cena sa vykazuje v súlade so štandardnou trhovou konvenciou. Hodnota uvedená v tomto poli musí byť v súlade s hodnotou uvedenou v poli „Označenie ceny“. Ak cena momentálne nie je k dispozícii, ale čaká sa jej uvedenie („PNDG“), alebo ak ju nemožno použiť („NOAP“), toto pole sa nevypĺňa.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/13} v prípade, že je cena vyjadrená ako peňažná hodnota {DECIMAL- 11/10} v prípade, že je cena vyjadrená ako percentuálna hodnota alebo výnos {DECIMAL-18/17} v prípade, že je cena vyjadrená v bázických bodoch
4	Chýbajúca cena	Pre všetky finančné nástroje	Ak cena momentálne nie je k dispozícii, ale čaká sa jej uvedenie, uvádza sa hodnota „PNDG“. Ak cenu nemožno použiť, uvádza sa hodnota „NOAP“.	RM, MTF, OTF, APA	„PNDG“ v prípade, že cena nie je k dispozícii „NOAP“ v prípade, že cenu nemožno použiť
5	Mena, v ktorej je vyjadrená cena	Pre všetky finančné nástroje	Hlavná mena, v ktorej je vyjadrená cena (uplatniteľné v prípade, ak je cena vyjadrená ako peňažná hodnota).	RM, MTF, OTF, APA	{CURRENCY CODE_3}
6	Označenie ceny	Pre všetky finančné nástroje	Údaj o tom, či je cena vyjadrená ako peňažná hodnota, percentuálna hodnota, v bázických bodoch alebo ako výnos Označenie ceny sa vykazuje v súlade so štandardnou trhovou konvenciou. V prípade swapov na kreditné zlyhanie sa v tomto poli uvádza „BAPO“. V prípade dlhopisov (iných ako ETN a ETC) sa v tomto poli uvádza percentuálna hodnota (PERC) pomyselnej hodnoty. Ak cena vyjadrená percentuálnou hodnotou nie je štandardnou trhovou konvenciou, vypĺňa sa YIEL, BAPO alebo MONE v súlade so štandardnou trhovou konvenciou. Hodnota uvedená v tomto poli musí byť v súlade s hodnotou uvedenou v poli „Cena“. Ak je cena uvedená v peňažnom vyjadrení, uvádza sa v hlavnej menovej jednotke.	RM, MTF, OTF, APA	„MONE“ – peňažná hodnota „PERC“ – percentuálna hodnota „YIEL“ – výnos „BAPO“ – bázické body

▼M4

#	Identifikátor poľa	Finančné nástroje	Opis a údaje, ktoré sa majú uverejniť	Druh miesta vykonania alebo zverejnenia	Formát, ktorý sa má vyplniť, ako sa uvádza v tabuľke 1
			Ak cena momentálne nie je k dispozícii, ale čaká sa jej uvedenie („PNDG“), alebo ak ju nemožno použiť („NOAP“), toto pole sa nevypĺňa.		
7	Množstvo	Pre všetky finančné nástroje s výnimkou prípadov opísaných v článku 11 ods. 1 písm. a) a b) tohto nariadenia.	V prípade finančných nástrojov, s ktorými sa obchoduje v jednotkách, počet jednotiek finančného nástroja. Inak ostáva prázdne.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL- 18/17}
8	Množstvo v mernej jednotke	Pre zmluvy určené v jednotkách pri komoditných derivátoch, derivátoch C10, derivátoch na emisné kvóty a emisných kvótach s výnimkou prípadov opísaných v článku 11 ods. 1 písm. a) a b) tohto nariadenia.	Zodpovedajúca hodnota obchodovaných komodít alebo emisných kvót vyjadrená v mernej jednotke.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL- 18/17}
9	Označenie množstva v mernej jednotke	Pre zmluvy určené v jednotkách pri komoditných derivátoch, derivátoch C10, derivátoch na emisné kvóty a emisných kvótach s výnimkou prípadov opísaných v článku 11 ods. 1 písm. a) a b) tohto nariadenia.	Údaj o označení, pomocou ktorého je vyjadrené množstvo v mernej jednotke.	RM, MTF, OTF, APA	„TOCD“ — tony ekvivalentu oxidu uhličitého v prípade akejkoľvek zmluvy týkajúcej sa emisných kvót „TONE“ — metrické tony „MWHO“ — megawatthodiny „MBTU“ – jeden milión britských tepelných jednotiek „THMS“ – thermy „DAYS“ – dni alebo {ALPHANUM-4} inak

▼M4

#	Identifikátor poľa	Finančné nástroje	Opis a údaje, ktoré sa majú uverejniť	Druh miesta vykonania alebo zverejnenia	Formát, ktorý sa má vyplniť, ako sa uvádza v tabuľke 1
10	Pomyselná hodnota	Pre všetky finančné nástroje s výnimkou prípadov opísaných v článku 11 ods. 1 písm. a) a b) tohto nariadenia.	V tomto poli sa uvádza: i) pri dlhopisoch (okrem ETC a ETN) menovitá hodnota, čo je suma vyplatená investorovi pri splatení; ii) pri ETC, ETN a sekuritizovaných derivátoch počet nástrojov vymenených medzi kupujúcimi a predávajúcimi, pričom tento počet sa vynásobí cenou nástroja vymeneného v rámci danej konkrétnej transakcie. Ekvivalentne údaj z poľa cena vynásobený údajom z poľa množstvo; iii) pri štruktúrovaných finančných produktoch (SFP) nominálna hodnota na jednotku vynásobená počtom nástrojov v čase transakcie; iv) pri swapoch na kreditné zlyhanie pomyselná hodnota, na ktorú sa vzťahuje nadobúdané alebo prevádzané zabezpečenie; v) pri opciách, swapciách, swapoch iných než tie, ktoré sú uvedené v bode iv), futures a forwardoch pomyselná hodnota danej zmluvy; vi) pri emisných kvótach výsledné množstvo za príslušnú cenu stanovenú v zmluve v čase transakcie. Ekvivalentne údaj z poľa cena vynásobený údajom z poľa množstvo v mernej jednotke; vii) pri stávkach na rozpätie peňažná hodnota stavená na bod cenovej zmeny podkladového finančného nástroja v čase transakcie;	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/5}

▼M4

#	Identifikátor poľa	Finančné nástroje	Opis a údaje, ktoré sa majú uverejniť	Druh miesta vykonania alebo zverejnenia	Formát, ktorý sa má vyplniť, ako sa uvádza v tabuľke 1
			viii) pri rozdielových zmluvách (CFD) počet nástrojov vymenených medzi kupujúcimi a predávajúcimi, pričom tento počet sa vynásobí cenou nástroja vymeneného v rámci danej konkrétnej transakcie. Ekvivalentne údaj z poľa cena vynásobený údajom z poľa množstvo.		
11	Mena pomyselnej hodnoty	Pre všetky finančné nástroje s výnimkou prípadov opísaných v článku 11 ods. 1 písm. a) a b) tohto nariadenia.	Hlavná mena, v ktorej je denominovaná pomyselná hodnota. V prípade zmluvy o devízových derivátoch alebo multimenového swapu či swapcie, pri ktorých je podkladový swap viacmenový swap alebo menová CFD alebo zmluva o stávke na rozpätie, to bude pomyselná mena časti 1.	RM, MTF, OTF, APA	{CURRENCY CODE_3}
12	[vypúšťa sa]				
13	Miesto vykonania	Pre všetky finančné nástroje	Identifikácia miesta, kde sa transakcia vykonala. V prípade transakcií vykonaných na obchodnom mieste EÚ sa použije MIC segmentu podľa ISO 10383. Ak MIC segmentu neexistuje, použije sa prevádzkový MIC. Ak sa v prípade finančných nástrojov prijatých na obchodovanie alebo obchodovaných na obchodnom mieste transakcia s daným finančným nástrojom vykoná prostredníctvom systematického internalizátora, použije sa „SINT“. Ak sa v prípade finančných nástrojov prijatých na obchodovanie alebo obchodovaných na obchodnom mieste transakcia s daným finančným nástrojom nevykonáva ani na obchodnom mieste EÚ ani prostredníctvom systematického internalizátora, použije sa kód MIC „XOFF“. Ak sa transakcia vykonáva na organizovanej obchodnej platforme mimo EÚ, popri hodnote „XOFF“ sa vyžaduje aj vyplnenie poľa „Obchodné miesto vykonania v tretej krajine“.	RM, MTF, OTF, APA	{MIC} – obchodné miesta EÚ alebo „SINT“ – systematický internalizátor „XOFF“ – inak

▼M4

#	Identifikátor poľa	Finančné nástroje	Opis a údaje, ktoré sa majú uverejniť	Druh miesta vykonania alebo zverejnenia	Formát, ktorý sa má vyplniť, ako sa uvádza v tabuľke 1
14	Obchodné miesto vykonania v tretej krajine	Pre všetky finančné nástroje	Identifikácia obchodného miesta v tretej krajine, kde sa transakcia vykonala. Uvádza sa MIC segmentu podľa normy ISO 10383. Ak MIC segmentu neexistuje, použije sa prevádzkový MIC. Ak sa transakcia nevykoná na obchodnom mieste v tretej krajine, pole sa nevypĺňa.	APA	{MIC}
15	Dátum a čas zverejnenia	Pre všetky finančné nástroje	Dátum a čas, kedy obchodné miesto alebo APA zverejnili transakciu. V prípade transakcií vykonaných na obchodnom mieste musí byť miera podrobnosti v súlade s požiadavkami stanovenými v článku 12 delegovaného nariadenia (EÚ) 2025/1155. V prípade transakcií nevykonaných na obchodnom mieste sa čas uvádza s presnosťou aspoň na najbližšiu sekundu.	RM, MTF, OTF, APA	{DATE_TIME_ FORMAT}
16	Miesto zverejnenia	Pre všetky finančné nástroje	Kód používaný na identifikáciu obchodného miesta a APA zverejňujúcich transakciu.	RM, MTF, OTF, APA	{MIC}
17	Identifikačný kód transakcie	Pre všetky finančné nástroje	Alfanumerický kód, ktorý prideľujú obchodné miesta [podľa článku 12 delegovaného nariadenia Komisie (EÚ) 2017/580 ([2])] a APA a ktorý sa používa pri každom ďalšom odkaze na konkrétny obchod.	RM, MTF, OTF, APA	{ALPHA NUMERICAL-52}
18	Transakcia, ktorá sa má zúčtovať	Pre deriváty	Kód na identifikáciu toho, či sa transakcia zúčtuje.	RM, MTF, OTF, APA	„TRUE“ – transakcia sa má zúčtovať „FALSE“ – transakcia sa nemá zúčtovať

▼M4

#	Identifikátor poľa	Finančné nástroje	Opis a údaje, ktoré sa majú uverejniť	Druh miesta vykonania alebo zverejnenia	Formát, ktorý sa má vyplniť, ako sa uvádza v tabuľke 1
19	Označenia	Pre všetky finančné nástroje	Jedno alebo viaceré polia by sa mali vyplniť príslušnými označeniami opísanými v tabuľke 3 prílohy II. Ak sa neuplatňuje žiadna z uvedených okolností, transakcia by sa mala zverejniť bez označenia. Ak je možná kombinácia označení a ich uvedenie v jednom poli, tieto označenia by sa mali uvádzať oddelene čiarkami.	RM, MTF, OTF, APA	Ako sa uvádza v tabuľke 3 prílohy II
20	Systém obchodovania	Pre všetky finančné nástroje	Druh systému obchodovania, v rámci ktorého sa transakcia vykonala. Keď sa v poli „Miesto vykonania“ uvedie „SINT“ alebo „XOFF“, toto pole sa nevypĺňa.	RM, MTF, OTF	„CLOB“ – systém obchodovania na základe centrálnej knihy limitovaných pokynov. „QDTS“ – systémy obchodovania riadené kotáciami sú systémy, pri ktorých sa transakcie uzatvárajú na základe záväzných kotácií, ktoré sú kontinuálne sprístupňované účastníkom, čo si od tvorcov trhu vyžaduje, aby udržiavali kotácie v objeme, ktorým sa dosahuje rovnováha medzi potrebami členov a účastníkov obchodovať v komerčnom objeme a rizikom, ktorému sa sám tvorca trhu vystavuje. „PATS“ – systémy obchodovania formou periodických aukcií. „RFQT“ – systémy obchodovania formou žiadostí o kotácie sú systémy obchodovania, pri ktorých sa kotácia alebo kotácie poskytujú na základe žiadosti o kotáciu, ktorú predložil jeden alebo viacerí iní členovia či účastníci. Kotácia je vykonateľná výlučne žiadajúcim členom alebo účastníkom trhu. Žiadajúci člen alebo účastník môže uzatvoriť transakciu prijatím kotácie alebo kotácií, ktoré mu boli na jeho žiadosť poskytnuté.

▼M4

#	Identifikátor poľa	Finančné nástroje	Opis a údaje, ktoré sa majú uverejniť	Druh miesta vykonania alebo zverejnenia	Formát, ktorý sa má vyplniť, ako sa uvádza v tabuľke 1
					„VOIC“ – systém hlasového obchodovania je systém obchodovania, v prípade ktorého sa transakcie medzi členmi dohadujú prostredníctvom hlasového vyjednávania. „HYBR“ – hybridný systém obchodovania je systém, ktorý patrí do dvoch alebo viacerých uvedených druhov systémov obchodovania. „OTHR“ – akýkoľvek iný systém obchodovania, t. j. akýkoľvek iný druh systému obchodovania, ktorý nie je uvedený vyššie.
21	Počet transakcií	Pre štátne dlhové nástroje	Toto pole by sa malo vyplniť počtom vykonaných transakcií, keď sa podľa článku 11 ods. 3 písm. b) nariadenia (EÚ) č. 600/2014 vyžaduje odklad zverejnenia údajov o viacerých transakciách v súhrnnej podobe.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/17}.

([1]) Delegované nariadenie Komisie (EÚ) 2025/1155 z 12. júna 2025, ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 600/2014, pokiaľ ide o regulačné technické predpisy, ktorými sa spresňujú vstupné a výstupné údaje konsolidovaných informačných systémov, synchronizácia obchodných hodín a prerozdeľovanie príjmov poskytovateľom konsolidovaného informačného systému pre akcie a ETF, a ktorým sa zrušuje delegované nariadenie Komisie (EÚ) 2017/574 (Ú. v. EÚ L, 2025/1155, 3.11.2025, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2025/1155/oj).

([2]) Delegované nariadenie Komisie (EÚ) 2017/580 z 24. júna 2016, ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 600/2014, pokiaľ ide o regulačné technické predpisy o uchovávaní relevantných údajov týkajúcich sa pokynov súvisiacich s finančnými nástrojmi (Ú. v. EÚ L 87, 31.3.2017, s. 193, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/580/oj).

▼M4

Tabuľka 3

Zoznam označení na účely poobchodnej transparentnosti

OZNAČENIA ODKLADU V RÁMCI POOBCHODNEJ TRANSPARENTNOSTI PRE DERIVÁTY

Označenie	Názov	Druh miesta vykonania alebo zverejnenia	Opis
„LRGS“	Označenie transakcie LIS na poobchodné účely	RM, MTF, OTF, APA	Transakcie vykonané v rámci poobchodného odkladu z dôvodu veľkého rozsahu.
„ILQD“	Označenie transakcie s nelikvidnými nástrojmi	RM, MTF, OTF, APA	Transakcie vykonané v rámci odkladu pre nástroje, pre ktoré neexistuje likvidný trh
„SIZE“	Označenie transakcie SSTI na poobchodné účely	RM, MTF, OTF, APA	Transakcie vykonané v rámci poobchodného odkladu z dôvodu objemu špecifického pre daný nástroj.

OZNAČENIA ODKLADU V RÁMCI POOBCHODNEJ TRANSPARENTNOSTI PRE DLHOPISY (S VÝNIMKOU ETC A ETN)

Označenie	Názov	Druh miesta vykonania alebo zverejnenia	Opis
MLF1	Označenie stredne veľkej transakcie na likvidnom trhu	RM, MTF, OTF, APA	Transakcie s dlhopismi, na ktoré sa vzťahuje odklad uplatniteľný na stredne veľké transakcie s finančným nástrojom, pre ktorý existuje likvidný trh, v súlade s článkom 8a ods. 1 písm. a) tohto nariadenia.
MIF2	Označenie stredne veľkej transakcie na nelikvidnom trhu	RM, MTF, OTF, APA	Transakcie s dlhopismi, na ktoré sa vzťahuje odklad uplatniteľný na stredne veľké transakcie s finančným nástrojom, pre ktorý neexistuje likvidný trh, v súlade s článkom 8a ods. 1 písm. b) tohto nariadenia.
LLF3	Označenie veľkej transakcie na likvidnom trhu	RM, MTF, OTF, APA	Transakcie s dlhopismi, na ktoré sa vzťahuje odklad uplatniteľný na veľké transakcie s finančným nástrojom, pre ktorý existuje likvidný trh, v súlade s článkom 8a ods. 1 písm. c) tohto nariadenia.
LIF4	Označenie veľkej transakcie na nelikvidnom trhu	RM, MTF, OTF, APA	Transakcie s dlhopismi, na ktoré sa vzťahuje odklad uplatniteľný na veľké transakcie s finančným nástrojom, pre ktorý neexistuje likvidný trh, v súlade s článkom 8a ods. 1 písm. d) tohto nariadenia.

▼M4

OZNAČENIA ODKLADU V RÁMCI POOBCHODNEJ TRANSPARENTNOSTI PRE DLHOPISY (S VÝNIMKOU ETC A ETN)

Označenie	Názov	Druh miesta vykonania alebo zverejnenia	Opis
VLF5	Označenie veľmi veľkej transakcie na likvidnom trhu	RM, MTF, OTF, APA	Transakcie s dlhopismi, na ktoré sa vzťahuje odklad uplatniteľný na veľmi veľké transakcie s finančným nástrojom, pre ktorý existuje likvidný trh, v súlade s článkom 8a ods. 1 písm. e) tohto nariadenia.
VIF5	Označenie veľmi veľkej transakcie na nelikvidnom trhu	RM, MTF, OTF, APA	Transakcie s dlhopismi, na ktoré sa vzťahuje odklad uplatniteľný na veľmi veľké transakcie s finančným nástrojom, pre ktorý neexistuje likvidný trh, v súlade s článkom 8a ods. 1 písm. e) tohto nariadenia.

OZNAČENIA ODKLADU V RÁMCI POOBCHODNEJ TRANSPARENTNOSTI PRE ETC, ETN, SFP A EMISNÉ KVÓTY

Označenie	Názov	Druh miesta vykonania alebo zverejnenia	Opis
DEFF	Odklad pre ETC, ETN, SFP a emisné kvóty	RM, MTF, OTF, APA	Transakcie s ETC, ETN, SFP a emisnými kvótami, na ktoré sa vzťahuje odklad, ako sa stanovuje v článku 8a ods. 2 a 3 tohto nariadenia.

OZNAČENIA DODATOČNÉHO ODKLADU PRE DERIVÁTY

Článok 11 ods. 1 písm. a) bod i)	„LMTF“	Označenie obmedzených údajov	RM, MTF, OTF, APA	Prvá správa s uverejnením obmedzených údajov v súlade s článkom 11 ods. 1 písm. a) bodom i).
	„FULF“	Označenie úplných údajov	RM, MTF, OTF, APA	Transakcia, pre ktorú boli predtým zverejnené obmedzené údaje v súlade s článkom 11 ods. 1 písm. a) bodom i).
Článok 11 ods. 1 písm. a) bod ii)	„DATF“	Označenie dennej súhrnnej transakcie	RM, MTF, OTF, APA	Uverejnenie dennej súhrnnej transakcie v súlade s článkom 11 ods. 1 písm. a) bodom ii).
	„FULA“	Označenie úplných údajov	RM, MTF, OTF, APA	Jednotlivé transakcie, pre ktoré boli predtým zverejnené súhrnné údaje v súlade s článkom 11 ods. 1 písm. a) bodom ii).

▼M4

OZNAČENIA DODATOČNÉHO ODKLADU PRE DERIVÁTY				
Článok 11 ods. 1 písm. b)	„VOLO“	Označenie nezverejnenia objemu	RM, MTF, OTF, APA	Transakcia, pre ktorú sú zverejnené obmedzené údaje v súlade s článkom 11 ods. 1 písm. b).
	„FULV“	Označenie úplných údajov	RM, MTF, OTF, APA	Transakcia, pre ktorú boli predtým zverejnené obmedzené údaje v súlade s článkom 11 ods. 1 písm. b).
Článok 11 ods. 1 písm. c)	„FWAF“	Označenie štvortýždenného súhrnu	RM, MTF, OTF, APA	Uverejnenie súhrnných transakcií v súlade s článkom 11 ods. 1 písm. c).
	„FULJ“	Označenie úplných údajov	RM, MTF, OTF, APA	Jednotlivé transakcie, ktoré predtým využívali súhrnné uverejnenie v súlade s článkom 11 ods. 1 písm. c).

OZNAČENIA DODATOČNÉHO ODKLADU PRE ŠTÁTNE DLHOPISY				
Článok 11 ods. 3 písm. a)	„OMIS“	Označenie nezverejnenia objemu	RM, MTF, OTF, APA	Transakcia, pre ktorú sú zverejnené obmedzené údaje v súlade s článkom 11 ods. 3 písm. a) nariadenia (EÚ) č. 600/2014.
	„FULO“	Označenie úplných údajov	RM, MTF, OTF, APA	Transakcia, pre ktorú boli predtým zverejnené obmedzené údaje v súlade s článkom 11 ods. 3 písm. a) nariadenia (EÚ) č. 600/2014.
Článok 11 ods. 3 písm. b)	„AGFW“	Označenie štvortýždenného súhrnu	RM, MTF, OTF, APA	Zverejnenie súhrnných transakcií v súlade s článkom 11 ods. 3 písm. b) nariadenia (EÚ) č. 600/2014.
	„FULG“	Označenie úplných údajov	RM, MTF, OTF, APA	Jednotlivé transakcie, ktoré predtým využívali súhrnné zverejnenie v súlade s článkom 11 ods. 3 písm. b) nariadenia (EÚ) č. 600/2014.

INÉ OZNAČENIA			
Označenie	Názov	Druh miesta vykonania alebo zverejnenia	Opis
„BENC“	Označenie transakcie za referenčnú hodnotu	RM, MTF, OTF, APA	Transakcie vykonané s odkazom na cenu, ktorá je vypočítaná vo viacerých okamihoch na základe danej referenčnej hodnoty, ako je objemovo vážená priemerná cena alebo časovo vážená priemerná cena.
„NPFT“	Označenie necenotvornej transakcie	RM, MTF, OTF, APA	Necenotvorné transakcie, ako sa stanovuje v článku 2 ods. 5 delegovaného nariadenia (EÚ) 2017/590.

▼M4

INÉ OZNAČENIA

Označenie	Názov	Druh miesta vykonania alebo zverejnenia	Opis
„TPAC“	Označenie súbornej transakcie	RM, MTF, OTF, APA	Súborné transakcie, ktoré nepredstavujú výmenu za fyzické aktíva, v zmysle vymedzenia v článku 2 ods. 1 bode 50 písm. b) nariadenia (EÚ) č. 600/2014.
„XFPH“	Označenie transakcie predstavujúcej výmenu za fyzické aktíva	RM, MTF, OTF, APA	Výmena za fyzické aktíva v zmysle vymedzenia v článku 2 ods. 1 bode 48 nariadenia (EÚ) č. 600/2014.
„CANC“	Označenie zrušenia	RM, MTF, OTF, APA	Keď sa predtým zverejnená transakcia zruší.
„AMND“	Označenie zmeny	RM, MTF, OTF, APA	Keď sa predtým zverejnená transakcia zmení.
„PORT“	Označenie portfóliového obchodu	RM, MTF, OTF, APA	Transakcia s piatimi alebo viacerými rôznymi finančnými nástrojmi, ak s týmito transakciami obchoduje ten istý klient v rovnakom čase a za cenu jedného lotu, a ktorá nie je „súbornou transakciou“ v zmysle vymedzenia v článku 2 ods. 1 bode 50 nariadenia (EÚ) č. 600/2014.
„MTCH“	Označenie obchodovania párovaním na vlastný účet	OTF	Obchodovanie párovaním na vlastný účet, ako sa stanovuje v článku 4 ods. 1 bode 38 smernice 2014/65/EÚ.
„NEGO“	Označenie dohodnutej transakcie	RM, MTF, OTF	Transakcie, ktoré sú dohodnuté súkromne, ale oznamujú sa podľa pravidiel obchodného miesta.

▼M3

Tabuľka 4

Miera objemu

Druh nástroja	Objem
Všetky dlhopisy s výnimkou ETC a ETN a štruktúrovaných finančných produktov	„Pomyselná hodnota“ obchodovanej zmluvy podľa poľa 10 tabuľky 2 prílohy II k tomuto nariadeniu.
Druhy dlhopisov ETC a ETN	„Pomyselná hodnota“ obchodovanej zmluvy podľa poľa 10 tabuľky 2 prílohy II k tomuto nariadeniu.
Sekuritizované deriváty	„Pomyselná hodnota“ obchodovanej zmluvy podľa poľa 10 tabuľky 2 prílohy II k tomuto nariadeniu.
Úrokové deriváty	„Pomyselná hodnota“ obchodovanej zmluvy podľa poľa 10 tabuľky 2 prílohy II k tomuto nariadeniu.
Devízové deriváty	„Pomyselná hodnota“ obchodovanej zmluvy podľa poľa 10 tabuľky 2 prílohy II k tomuto nariadeniu.
Akciové deriváty	„Pomyselná hodnota“ obchodovanej zmluvy podľa poľa 10 tabuľky 2 prílohy II k tomuto nariadeniu.
Komoditné deriváty	„Pomyselná hodnota“ obchodovanej zmluvy podľa poľa 10 tabuľky 2 prílohy II k tomuto nariadeniu.
Kreditné deriváty	„Pomyselná hodnota“ obchodovanej zmluvy podľa poľa 10 tabuľky 2 prílohy II k tomuto nariadeniu.
Rozdielové zmluvy	„Pomyselná hodnota“ obchodovanej zmluvy podľa poľa 10 tabuľky 2 prílohy II k tomuto nariadeniu.
Deriváty C10	„Pomyselná hodnota“ obchodovanej zmluvy podľa poľa 10 tabuľky 2 prílohy II k tomuto nariadeniu.
Deriváty na emisné kvóty	„Množstvo v mernej jednotke“ podľa poľa 8 tabuľky 2 prílohy II k tomuto nariadeniu.
Emisné kvóty	„Množstvo v mernej jednotke“ podľa poľa 8 tabuľky 2 prílohy II k tomuto nariadeniu.

▼B

PRÍLOHA III

Posúdenie likvidity, prahové hodnoty LIS a SSTI pre nekapitálové finančné nástroje

▼M4

1. **Pokyny na účely tejto prílohy**

1. Odkaz na nesplatený objem emisie dlhopisov v tabuľke 2.2 sa vzťahuje na celkovú hodnotu dlhopisov, ktoré boli emitované a v súčasnosti sú v držbe investorov.

2. Odkaz na „triedu aktív“ je odkaz na tieto triedy finančných nástrojov: dlhopisy, štruktúrované finančné produkty, sekuritizované deriváty, úrokové deriváty, akciové deriváty, komoditné deriváty, devízové deriváty, kreditné deriváty, deriváty C10, rozdielové zmluvy, emisné kvóty a deriváty na emisné kvóty.

3. Odkaz na „podtriedu aktív“ je odkaz na triedu aktív segmentovanú na podrobnejšiu mieru rozčlenenia na základe typu zmluvy a/alebo druhu podkladového nástroja.

4. Odkaz na „podtriedu“ je odkaz na podtriedu aktív segmentovanú na podrobnejšiu mieru rozčlenenia na základe ďalších kvalitatívnych kritérií pre segmentáciu podľa tabuliek 2.2 až 13.3 tejto prílohy.

5. „Priemerná denná pomyselná hodnota“ (average daily notional amount, ADNA) je celková pomyselná hodnota pre konkrétny finančný nástroj určená podľa miery objemu uvedenej v tabuľke 4 prílohy II a vykonaná v období uvedenom v článku 13 ods. 7, vydelená počtom obchodných dní v danom období alebo prípadne v tej časti roka, počas ktorej bol finančný nástroj prijatý na obchodovanie alebo obchodovaný na obchodnom mieste a obchodovanie nebolo pozastavené.

6. „Priemerný denný počet obchodov“ je celkový počet transakcií vykonaných pre konkrétny finančný nástroj v období stanovenom v článku 13 ods. 7, vydelený počtom obchodných dní v danom období alebo prípadne v tej časti roka, počas ktorej bol finančný nástroj prijatý na obchodovanie alebo obchodovaný na obchodnom mieste a obchodovanie nebolo pozastavené.

7. „Futures“ je zmluva na kúpu alebo predaj komodity alebo finančného nástroja k určenému dátumu v budúcnosti za cenu dohodnutú kupujúcim a predávajúcim pri začatí zmluvy. Všetky futures majú štandardné podmienky určujúce minimálne množstvo a kvalitu, ktorá môže byť nakúpená alebo predaná, najnižšiu sumu, o ktorú sa môže zmeniť cena, postupy dodania, dátum splatnosti a ďalšie charakteristiky súvisiace s danou zmluvou.

8. „Opcia“ je zmluva, ktorá dáva vlastníkovi právo, nie však povinnosť, kúpiť (kúpna opcia) alebo predať (predajná opcia) určitý finančný nástroj alebo komoditu za vopred stanovenú cenu alebo realizačnú cenu k určitému dátumu v budúcnosti alebo dátumu uplatnenia alebo do určitého dátumu v budúcnosti alebo dátumu uplatnenia.

9. „Swap“ je zmluva, v ktorej sa dve strany dohodnú k určitému dátumu v budúcnosti vymeniť peňažné toky v jednom finančnom nástroji za peňažné toky v inom finančnom nástroji.

10. „Portfóliový swap“ je zmluva, prostredníctvom ktorej môžu koncoví používatelia obchodovať s viacnásobnými swapmi.

▼**M4**

11. „Forward“ alebo „forwardová dohoda“ je súkromná dohoda medzi dvomi stranami o kúpe alebo predaji komodity alebo finančného nástroja k určenému dátumu v budúcnosti za cenu dohodnutú kupujúcim a predávajúcim pri začatí zmluvy.

12. „Swapcia“ alebo „opcia na swap“ je zmluva, ktorá dáva vlastníkovi právo, nie však povinnosť, uzatvoriť swap k určitému dátumu v budúcnosti alebo dátumu uplatnenia alebo do určitého dátumu v budúcnosti alebo dátumu uplatnenia.

13. „Futures na swap“ je futures, ktorý dáva vlastníkovi povinnosť uzatvoriť k určitému dátumu v budúcnosti alebo do určitého dátumu v budúcnosti swap.

14. „Forward na swap“ je forwardová zmluva, ktorá dáva vlastníkovi povinnosť uzatvoriť k určitému dátumu v budúcnosti alebo do určitého dátumu v budúcnosti swap.

▼M4

2. **Dlhopisy**

Tabuľka 2.2.

Dlhopisy (všetky druhy dlhopisov s výnimkou ETC a ETN) – triedy, pre ktoré neexistuje likvidný trh

Každý jednotlivý dlhopis sa určí ako dlhopis, pre ktorý neexistuje likvidný trh podľa článku 6a, ak je charakterizovaný konkrétnou kombináciou charakteristík dlhopisu, ako je uvedené v každom riadku tabuliek nižšie.

Štátne a iné verejné dlhopisy						
Identifikačný kód skupiny	**Identifikačný kód MiFIR**	**Druh dlhopisu**	**Emitent alebo krajina emitenta**	**Zostatková splatnosť**	**Druh kupónu**	**Nesplatený objem emisie**
	RTS2#3	RTS2#9	Krajina emitenta uvedeného v poli delegovaného nariadenia Komisie 2017/585 ([1]) („RTS23“) „Identifikátor emitenta alebo organizátora obchodného miesta“	Čas zostávajúci do dátumu splatnosti vykázaný v poli RTS23 „Dátum splatnosti“	Tretie písmeno kódu CFI vykázaného v poli RTS23 „Klasifikácia nástroja“	Pole RTS23 „Celková vydaná nominálna suma“, prepočítané na EUR
G1	DLHOPIS	EUSB EUSB je dlhopis, ktorý nie je konvertibilným ani krytým dlhopisom a emituje ho štátny emitent: a) Únia; b) členský štát vrátane ministerstva, vládnej agentúry alebo účelovo vytvoreného subjektu členského štátu; c) v prípade federatívneho členského štátu člen danej federácie; d) účelovo vytvorený subjekt pre niekoľko členských štátov; e) medzinárodná finančná inštitúcia zriadená dvoma alebo viacerými členskými štátmi, ktorej účelom je mobilizovať finančné prostriedky a poskytovať finančnú pomoc v prospech svojich členov, ktorí majú alebo ktorým hrozia vážne finančné problémy; f) Európska investičná banka; g) štátny subjekt tretej krajiny.	Krajinou emitenta je členský štát, Spojené štáty americké alebo Spojené kráľovstvo; ALEBO Emitentom je Únia.	Nie viac ako 10 rokov	F (pevný kupón)	Menej ako 5 000 000 000 EUR
G2	DLHOPIS	EUSB alebo OEPB OEPB je dlhopis, ktorý nie je konvertibilným ani krytým dlhopisom a emituje ho verejný subjekt, ktorý nie je štátnym emitentom.	Akýkoľvek nástroj, ktorý nepatrí do G1			Menej ako 1 000 000 000 EUR

([1]) Delegované nariadenie Komisie (EÚ) 2017/585 zo 14. júla 2016, ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 600/2014, pokiaľ ide o regulačné technické predpisy pre normy a formáty údajov týkajúce sa referenčných údajov o finančných nástrojoch, ako aj technických opatrení v súvislosti s opatreniami, ktoré má vypracovať Európsky orgán pre cenné papiere a trhy a príslušné orgány (Ú. v. EÚ L 87, 31.3.2017, s. 368, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/585/oj).

▼M4

Podnikové, konvertibilné a iné dlhopisy					
Identifikačný kód skupiny	**Identifikačný kód MiFIR**	**Druh dlhopisu**	**Mena**	**Ratingové hodnotenie**	**Nesplatený objem emisie**
	RTS2#3	RTS2#9	Mena nástroja vykázaná v poli RTS23 „Nominálna mena 1“		Pole RTS23 „Celková vydaná nominálna suma“, prepočítané na EUR
G3	DLHOPIS	CRPB, CVTB alebo OTHR CRPB je dlhopis, ktorý nie je ani konvertibilným ani krytým dlhopisom a ktorý je emitovaný európskou spoločnosťou zriadenou v súlade s nariadením Rady (ES) č. 2157/2001 ([1]) alebo niektorým z druhov spoločností uvedených v prílohe I alebo prílohe II k smernici Európskeho parlamentu a Rady 2013/34/EÚ ([2]) alebo ich ekvivalentom v tretích krajinách. CVTB je nástroj pozostávajúci z dlhopisu alebo sekuritizovaného dlhového nástroja s vloženým derivátom, ako napríklad opcia na kúpu podkladovej akcie.	EUR, GBP, USD	Investičný stupeň	Menej ako 500 000 000 EUR
G4	DLHOPIS	CRPB, CVTB alebo OTHR	Akýkoľvek nástroj, ktorý nepatrí do G3		Menej ako 500 000 000 EUR

([1]) Nariadenie Rady (ES) č. 2157/2001 z 8. októbra 2001 o stanovách európskej spoločnosti (SE) (Ú. v. ES L 294, 10.11.2001, s. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2001/2157/oj).
([2]) Smernica Európskeho parlamentu a Rady 2013/34/EÚ z 26. júna 2013 o ročných účtovných závierkach, konsolidovaných účtovných závierkach a súvisiacich správach určitých druhov podnikov, ktorou sa mení smernica Európskeho parlamentu a Rady 2006/43/ES a zrušujú smernice Rady 78/660/EHS a 83/349/EHS (Ú. v. EÚ L 182, 29.6.2013, s. 19, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2013/34/oj).

Kryté dlhopisy			
Identifikačný kód skupiny	**Identifikačný kód MiFIR**	**Druh dlhopisu**	**Nesplatený objem emisie**
	RTS2#3	RTS2#9	Pole RTS23 „Celková vydaná nominálna suma“, prepočítané na EUR
G5	DLHOPIS	CVDB CVDB sú dlhopisy uvedené v článku 52 ods. 4 smernice Európskeho parlamentu a Rady 2009/65/ES ([1])	Menej ako 500 000 000 EUR

([1]) Smernica Európskeho parlamentu a Rady 2009/65/ES z 13. júla 2009 o koordinácii zákonov, iných právnych predpisov a správnych opatrení týkajúcich sa podnikov kolektívneho investovania do prevoditeľných cenných papierov (PKIPCP) (Ú. v. EÚ L 302, 17.11.2009, s. 32, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2009/65/oj).

▼M4

Tabuľka 2.3.

Dlhopisy (všetky druhy dlhopisov s výnimkou ETC a ETN) – predobchodné prahové hodnoty LIS

Trieda aktív – dlhopisy (všetky druhy dlhopisov s výnimkou ETC a ETN)	
Druh dlhopisu	**Predobchodná LIS**
Štátny dlhopis a iný verejný dlhopis	5 000 000 EUR
Podnikový dlhopis, konvertibilný dlhopis a iný dlhopis	1 000 000 EUR
Krytý dlhopis	5 000 000 EUR

Tabuľka 2.4.

Dlhopisy (druhy dlhopisov ETC a ETN) – triedy, pre ktoré neexistuje likvidný trh

Trieda aktív – dlhopisy (druh dlhopisov ETC a ETN)	
Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6a považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa uplatňuje nasledujúca metodika:	
Komodity obchodované na burze (exchange traded commodities, ETC) – RTS2#3 = ETCS: dlhový nástroj vydaný emitentom v komoditách alebo komoditných derivátových zmluvách proti priamej investícii. Cena ETC sa priamo alebo nepriamo viaže na výkonnosť podkladového nástroja. ETC pasívne sleduje výkonnosť komodity alebo komoditných indexov, na ktoré sa vzťahuje.	Všetky ETC sa považujú za ETC, pre ktoré neexistuje likvidný trh
Dlhopisy obchodované na burze (exchange traded notes, ETN) – RTS2#3 = ETNS: dlhový nástroj vydaný emitentom v podkladových nástrojoch alebo podkladových derivátových zmluvách proti priamej investícii. Cena ETN sa priamo alebo nepriamo viaže na výkonnosť podkladového nástroja. ETN pasívne sleduje výkonnosť podkladového nástroja, na ktorý sa vzťahuje.	Všetky ETN sa považujú za ETN, pre ktoré neexistuje likvidný trh

Tabuľka 2.5.

Dlhopisy (druhy dlhopisov ETC a ETN) – predobchodná prahová hodnota LIS

Trieda aktív – dlhopisy (druh dlhopisov ETC a ETN)	
Druh dlhopisu	**Predobchodná LIS**
ETC	1 000 000 EUR
ETN	1 000 000 EUR

▼M4

Tabuľka 2.6.

Dlhopisy (všetky druhy dlhopisov s výnimkou ETC a ETN) – režim odkladu

Trieda aktív – dlhopisy (všetky druhy dlhopisov s výnimkou ETC a ETN)			
Druh dlhopisu	**Kategória**	**Likvidita**	**Veľkosť (väčšia alebo rovná)**
Štátny dlhopis v G1 podľa tabuľky 2.2	1	považovaný za majúci likvidný trh	15 000 000 EUR
	2	považovaný za taký, ktorý nemá likvidný trh	5 000 000 EUR
	3	považovaný za majúci likvidný trh	50 000 000 EUR
	4	považovaný za taký, ktorý nemá likvidný trh	15 000 000 EUR
	5	považovaný za majúci likvidný trh	100 000 000 EUR
	5	považovaný za taký, ktorý nemá likvidný trh	50 000 000 EUR
Štátny dlhopis a iný verejný dlhopis v G2 podľa tabuľky 2.2	1	považovaný za majúci likvidný trh	10 000 000 EUR
	2	považovaný za taký, ktorý nemá likvidný trh	1 000 000 EUR
	3	považovaný za majúci likvidný trh	20 000 000 EUR
	4	považovaný za taký, ktorý nemá likvidný trh	2 000 000 EUR
	5	považovaný za majúci likvidný trh	50 000 000 EUR
	5	považovaný za taký, ktorý nemá likvidný trh	5 000 000 EUR
Podnikový dlhopis, konvertibilný dlhopis a iný dlhopis v G3 podľa tabuľky 2.2	1	považovaný za majúci likvidný trh	1 500 000 EUR
	2	považovaný za taký, ktorý nemá likvidný trh	500 000 EUR
	3	považovaný za majúci likvidný trh	7 500 000 EUR
	4	považovaný za taký, ktorý nemá likvidný trh	2 000 000 EUR
	5	považovaný za majúci likvidný trh	15 000 000 EUR
	5	považovaný za taký, ktorý nemá likvidný trh	5 000 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – dlhopisy (všetky druhy dlhopisov s výnimkou ETC a ETN)			
Druh dlhopisu	**Kategória**	**Likvidita**	**Veľkosť (väčšia alebo rovná)**
Podnikový dlhopis, konvertibilný dlhopis a iný dlhopis v G4 podľa tabuľky 2.2	1	považovaný za majúci likvidný trh	1 000 000 EUR
	2	považovaný za taký, ktorý nemá likvidný trh	500 000 EUR
	3	považovaný za majúci likvidný trh	5 000 000 EUR
	4	považovaný za taký, ktorý nemá likvidný trh	2 000 000 EUR
	5	považovaný za majúci likvidný trh	10 000 000 EUR
	5	považovaný za taký, ktorý nemá likvidný trh	5 000 000 EUR
Kryté dlhopisy v G5 podľa tabuľky 2.2	1	považované za majúce likvidný trh	5 000 000 EUR
	2	považované za také, ktoré nemajú likvidný trh	1 000 000 EUR
	3	považované za majúce likvidný trh	20 000 000 EUR
	4	považované za také, ktoré nemajú likvidný trh	5 000 000 EUR
	5	považované za majúce likvidný trh	50 000 000 EUR
	5	považované za také, ktoré nemajú likvidný trh	10 000 000 EUR

3. **Štruktúrované finančné produkty (Structured Finance Products, SFP)**

Tabuľka 3.1.

SFP – triedy, pre ktoré neexistuje likvidný trh

Trieda aktív – štruktúrované finančné produkty (SFP)
Posúdenie triedy aktív SFP na účely určenia finančných nástrojov považovaných za finančné nástroje, pre ktoré neexistuje likvidný trh podľa článku 6a – RTS2#3 = SFPS.
Všetky SFP sa považujú za SFP, pre ktoré neexistuje likvidný trh

Tabuľka 3.2.

SFP – predobchodná prahová hodnota LIS

Trieda aktív – štruktúrované finančné produkty (SFP)
Predobchodná LIS
250 000 EUR

▼B

4. **Sekuritizované deriváty**

▼M3

Tabuľka 4.1.

Sekuritizované deriváty – triedy, pre ktoré neexistuje likvidný trh

Trieda aktív – sekuritizované deriváty
je prevoditeľný cenný papier v zmysle vymedzenia v článku 4 ods. 1 bode 44 písm. c) smernice 2014/65/EÚ odlišný od štruktúrovaných finančných produktov, ktorý musí zahŕňať aspoň:
a.1) plain vanilla kryté warranty, čo sú cenné papiere emitované finančnou inštitúciou, ktoré dávajú držiteľovi právo, nie však povinnosť: a) k dátumu ukončenia platnosti alebo do dátumu ukončenia platnosti kúpiť určité množstvo podkladového aktíva za vopred stanovenú realizačnú cenu, alebo v prípade, že bolo stanovené hotovostné vyrovnanie, dostať od predávajúceho úhradu kladného rozdielu medzi aktuálnou trhovou cenou a realizačnou cenou; alebo b) k dátumu ukončenia platnosti alebo do dátumu ukončenia platnosti predať určité množstvo podkladového aktíva za vopred stanovenú realizačnú cenu, alebo v prípade, že bolo stanovené hotovostné vyrovnanie, dostať od kupujúceho úhradu kladného rozdielu medzi realizačnou cenou a aktuálnou trhovou cenou;
a.2) warranty, čo sú cenné papiere emitované tým istým emitentom podkladového aktíva, ktoré dávajú držiteľovi právo, nie však povinnosť: a) k dátumu ukončenia platnosti alebo do dátumu ukončenia platnosti kúpiť určité množstvo podkladového aktíva za vopred stanovenú realizačnú cenu, alebo v prípade, že bolo stanovené hotovostné vyrovnanie, dostať od predávajúceho úhradu kladného rozdielu medzi aktuálnou trhovou cenou a realizačnou cenou, alebo b) k dátumu ukončenia platnosti alebo do dátumu ukončenia platnosti predať určité množstvo podkladového aktíva za vopred stanovenú realizačnú cenu, alebo v prípade, že bolo stanovené hotovostné vyrovnanie, dostať od kupujúceho úhradu kladného rozdielu medzi realizačnou cenou a aktuálnou trhovou cenou;
b) pákové certifikáty sú certifikáty, ktoré sledujú výkonnosť podkladového aktíva s pákovým efektom;
c) exotické kryté warranty sú kryté warranty, ktorých hlavnou zložkou je kombinácia opcií;
d) obchodovateľné práva, ktorých podkladovým aktívom je nekapitálový nástroj;
e) investičné certifikáty sú certifikáty, ktoré sledujú výkonnosť podkladového aktíva bez pákového efektu.
RTS2#3 = SDRV
Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa uplatňuje nasledujúca metodika
všetky sekuritizované deriváty sa považujú za deriváty, pre ktoré existuje likvidný trh

▼M4

Tabuľka 4.2.

Sekuritizované deriváty – predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS

Trieda aktív – sekuritizované deriváty		
Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS		
Predobchodná LIS	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

▼B

5. **Úrokové deriváty**

▼M3

Tabuľka 5.1.

Úrokové deriváty – triedy, pre ktoré neexistuje likvidný trh

Trieda aktív – úrokové deriváty				
každá zmluva v zmysle vymedzenia v prílohe I oddiele C bode 4 smernice 2014/65/EÚ, ktorej základným podkladovým nástrojom je úroková sadzba, dlhopis, úver, akýkoľvek kôš, portfólio alebo index vrátane úrokovej sadzby, dlhopisu, úveru alebo akéhokoľvek iného produktu predstavujúceho výkonnosť úrokovej sadzby, dlhopisu, úveru.				
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
Dlhopisové futures/forwardy **/Futures na dlhopisové futures**	podtrieda dlhopisových futures/forwardov je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS2#17) – emitent podkladového nástroja **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#18) – obdobie splatnosti podkladového dlhopisu s fyzickou dodávkou vymedzené takto:	5 000 000 EUR	10	keď sa určí, že pre podtriedu existuje likvidný trh, pokiaľ ide o konkrétnu skupinu časov do splatnosti, a pre podtriedu vymedzenú ďalšou skupinou časov do splatnosti sa určí, že pre ňu neexistuje

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
/Forward na dlhopisové futures **Futures na dlhopis** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = BOND** **alebo** **Forward na dlhopis** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FORW** **RTS2#16 = BOND** **alebo** **Futures na dlhopisové futures** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR**	**Krátkodobý:** podkladový dlhopis s fyzickou dodávkou s obdobím splatnosti do 4 rokov sa považuje za krátkodobý **Strednodobý:** podkladový dlhopis s fyzickou dodávkou s obdobím splatnosti od 4 do 8 rokov sa považuje za strednodobý **Dlhodobý:** podkladový dlhopis s fyzickou dodávkou s obdobím splatnosti od 8 do 15 rokov sa považuje za dlhodobý **Ultradlhodobý:** podkladový dlhopis s fyzickou dodávkou s obdobím splatnosti dlhším ako 15 rokov sa považuje za ultradlhodobý **Kritérium pre segmentáciu 3** – čas do skupiny splatností futures vymedzený takto: Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace Skupina splatností 2: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov Skupina splatností 3: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok Skupina splatností 4: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky Skupina splatností 5: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov			likvidný trh, je zmluva s prvým nastávajúcim mesiacom splatnosti určená ako zmluva, pre ktorú existuje likvidný trh 2 týždne pred uplynutím prvého mesiaca splatnosti

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
RTS2#5 = FUTR **RTS2#16 = BNFD** **alebo** **Forward na dlhopisové futures** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FORW** **RTS2#16 = BNFD**				
Opcia na dlhopisy **/Opcia na dlhopisovú opciu** **/Opcia na dlhopisové futures** **Opcia na dlhopisy** **Opcia na dlhopisovú opciu** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR**	Podtrieda opcií na dlhopisy je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS2#22) – základný podkladový dlhopis **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti opcie vymedzená takto: Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace Skupina splatností 2: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov Skupina splatností 3: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok Skupina splatností 4: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky Skupina splatností 5: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	5 000 000 EUR	10	

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
RTS2#5 = OPTN **RTS2#16 = BOND** **alebo** **Opcia na dlhopisovú opciu** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = BOND** **alebo** **Opcia na dlhopisové futures** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = BNFD**				

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
Úrokové futures a FRA/futures na dohodu o úrokových futures/ dohoda o forwardovej úrokovej miere na úrokové futures **Futures na úrokovú sadzbu** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = INTR** **alebo** **Dohoda o forwardovej úrokovej miere** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FRAS** **RTS2#16 = INTR** **alebo** **Futures na úrokové futures**	podtrieda úrokových futures je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS2#24) – podkladová úroková sadzba **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#25) – obdobie splatnosti podkladovej úrokovej sadzby **Kritérium pre segmentáciu 3** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti futures vymedzená takto: Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace Skupina splatností 2: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov Skupina splatností 3: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok Skupina splatností 4: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky Skupina splatností 5: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	500 000 000 EUR	10	keď sa určí, že pre podtriedu existuje likvidný trh, pokiaľ ide o konkrétnu skupinu časov do splatnosti, a pre podtriedu vymedzenú ďalšou skupinou časov do splatnosti sa určí, že pre ňu neexistuje likvidný trh, je zmluva s prvým nastávajúcim mesiacom splatnosti určená ako zmluva, pre ktorú existuje likvidný trh 2 týždne pred uplynutím prvého mesiaca splatnosti

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
RTS2#3 = DERV **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = IFUT** **alebo** **Dohoda o forwardovej úrokovej miere na úrokové futures** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FRAS** **RTS2#16 = IFUT**				
Úrokové opcie **/Opcia na úrokové futures/FRA** **/Opcia na úrokovú opciu**	Podtrieda úrokových opcií je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS2#24) – podkladová úroková sadzba **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#25) – obdobie splatnosti podkladovej úrokovej sadzby **Kritérium pre segmentáciu 3** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti opcie vymedzená takto: Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace	500 000 000 EUR	10	

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
/Opcia na opciu na úrokové futures/FRA **Opcia na úrokové futures/FRA// Opcia na úrokovú opciu** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = IFUT** **alebo** **Úroková opcia//Opcia na opciu na úrokové futures/FRA** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = INTR**	Skupina splatností 2: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov Skupina splatností 3: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok Skupina splatností 4: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky Skupina splatností 5: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov			

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
Swapcie **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = SWPT**	Podtrieda swapcií je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS2#16) – podkladový druh swapu vymedzený takto: swap na jednu menu s pevnými úrokovými sadzbami, futures/forwardy na swap na jednu menu s pevnými úrokovými sadzbami [**RTS2#16 = XXSC**] swap na jednu menu pevnej na pohyblivú úrokovú sadzbu, futures/forwardy na swap na jednu menu pevnej na pohyblivú úrokovú sadzbu [**RTS2#16 = XFSC**] swap na jednu menu s pohyblivými úrokovými sadzbami, futures/forwardy na swap na jednu menu s pohyblivými úrokovými sadzbami [**RTS2#16 = FFSC**] swap na jednu menu na infláciu, futures/forwardy na swap na jednu menu na infláciu [**RTS2#16 = IFSC**] jednodňový indexový swap na jednu menu, futures/forwardy na jednodňový indexový swap na jednu menu [**RTS2#16 = OSSC**] multimenový swap s pevnými úrokovými sadzbami, futures/forwardy na multimenový swap s pevnými úrokovými sadzbami **[RTS2#16 = XXMC]**	500 000 000 EUR	10	

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
	multimenový swap pevnej na pohyblivú úrokovú sadzbu, futures/forwardy na multimenový swap pevnej na pohyblivú úrokovú sadzbu [**RTS2#16 = XFMC**]			
	multimenový swap s pohyblivými úrokovými sadzbami, futures/forwardy na multimenový swap s pohyblivými úrokovými sadzbami [**RTS2#16 = FFMC**]			
	multimenový swap na infláciu, futures/forwardy na multimenový swap na infláciu [**RTS2#16 = IFMC**]			
	jednodňový indexový multimenový swap, futures/forwardy na jednodňový indexový multimenový swap [**RTS2#16 = OSMC**]			
	Kritérium pre segmentáciu 2 (RTS2#20) – mena, v ktorej je uvedená pomyselná hodnota, vymedzená ako mena, v ktorej je denominovaná pomyselná hodnota opcie			
	Kritérium pre segmentáciu 3 (RTS2#22 alebo RTS2#23) – index inflácie, ak je podkladovým druhom swapu buď swap na jednu menu na infláciu, alebo multimenový swap na infláciu			
	Kritérium pre segmentáciu 4 (RTS2#21) – skupina časov do splatnosti swapu vymedzená takto:			
	Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 mesiac			
	Skupina splatností 2: 1 mesiac < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace			

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
	Skupina splatností 3: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov Skupina splatností 4: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok Skupina splatností 5: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky Skupina splatností 6: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov **Kritérium pre segmentáciu 5** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti opcie vymedzená takto: **Skupina splatností 1**: 0 < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov **Skupina splatností 2**: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok **Skupina splatností 3**: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky **Skupina splatností 4**: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 5 rokov **Skupina splatností 5**: 5 rokov < čas do splatnosti ≤ 10 rokov **Skupina splatností 6:** viac ako 10 rokov			

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
„Multimenové swapy“ pevnej na pohyblivú úrokovú sadzbu alebo „krížové menové swapy“ a futures/forwardy/opcie na „multimenové swapy“ pevnej na pohyblivú úrokovú sadzbu alebo „krížové menové swapy“ swap alebo futures/forward/opcia na swap, kde si dve strany vymieňajú peňažné toky denominované v rôznych menách a peňažné toky jednej časti sú určené pevnou úrokovou sadzbou a peňažné toky druhej časti sú určené pohyblivou úrokovou sadzbou. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP alebo FONS alebo FWOS alebo OPTS RTS2#16 = XFMC	Podtrieda multimenových swapov pevnej na pohyblivú úrokovú sadzbu je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#13 a RTS23#42) – menový pár, v ktorom je uvedená pomyselná hodnota, vymedzený ako kombinácia dvoch mien, v ktorých sú denominované dve časti swapu **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti swapu vymedzená takto: Skupina splatností 1: 0 < splatnosť ≤ 1 mesiac Skupina splatností 2: 1 mesiac < splatnosť ≤ 3 mesiace Skupina splatností 3: 3 mesiace < splatnosť ≤ 6 mesiacov Skupina splatností 4: 6 mesiacov < splatnosť ≤ 1 rok Skupina splatností 5: 1 rok < splatnosť ≤ 2 roky Skupina splatností 6: 2 roky < splatnosť ≤ 3 roky … Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
„Multimenové swapy“ s pohyblivými úrokovými sadzbami alebo „krížové menové swapy“ a futures/forwardy/opcie na „multimenové swapy“ s pohyblivými úrokovými sadzbami alebo „krížové menové swapy“ swap alebo futures/forward/opcia na swap, kde si dve strany vymieňajú peňažné toky denominované v rôznych menách a kde sú peňažné toky oboch častí určené pohyblivými úrokovými sadzbami RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP alebo FONS alebo FWOS alebo OPTS RTS2#16 = FFMC	Podtrieda multimenových swapov s pohyblivými úrokovými sadzbami je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#13 a RTS23#42) – menový pár, v ktorom je uvedená pomyselná hodnota, vymedzený ako kombinácia dvoch mien, v ktorých sú denominované dve časti swapu **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti swapu vymedzená takto: Skupina splatností 1: 0 < splatnosť ≤ 1 mesiac Skupina splatností 2: 1 mesiac < splatnosť ≤ 3 mesiace Skupina splatností 3: 3 mesiace < splatnosť ≤ 6 mesiacov Skupina splatností 4: 6 mesiacov < splatnosť ≤ 1 rok Skupina splatností 5: 1 rok < splatnosť ≤ 2 roky Skupina splatností 6: 2 roky < splatnosť ≤ 3 roky … Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
„Multimenové swapy“ s pevnými úrokovými sadzbami alebo „krížové menové swapy“ a futures/forwardy/opcie na „multimenové swapy“ s pevnými úrokovými sadzbami alebo „krížové menové swapy“ swap alebo futures/forward/opcia na swap, kde si dve strany vymieňajú peňažné toky denominované v rôznych menách a kde sú peňažné toky oboch častí určené pevnými úrokovými sadzbami RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP alebo FONS alebo FWOS alebo OPTS RTS2#16 = XXMC	Podtrieda multimenových swapov s pevnými úrokovými sadzbami je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#13 a RTS23#42) – menový pár, v ktorom je uvedená pomyselná hodnota, vymedzený ako kombinácia dvoch mien, v ktorých sú denominované dve časti swapu **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti swapu vymedzená takto: Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 mesiac Skupina splatností 2: 1 mesiac < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace Skupina splatností 3: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov Skupina splatností 4: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok Skupina splatností 5: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky Skupina splatností 6: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
„Jednodňový indexový swap (OIS)“ na „multimenové swapy“ alebo „krížové menové swapy“ a futures/forwardy/opcie na „jednodňový indexový swap (OIS)“ na „multimenové swapy“ alebo „krížové menové swapy“ swap alebo futures/forward/opcia na swap, kde si dve strany vymieňajú peňažné toky denominované v rôznych menách a peňažné toky aspoň jednej časti sú určené sadzbou jednodňového indexového swapu (OIS) RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP alebo FONS alebo FWOS alebo OPTS RTS2#16 = OSMC	podtrieda jednodňového indexového swapu (OIS) na multimenové swapy je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#13 a RTS23#42) – menový pár, v ktorom je uvedená pomyselná hodnota, vymedzený ako kombinácia dvoch mien, v ktorých sú denominované dve časti swapu **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti swapu vymedzená takto: Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 mesiac Skupina splatností 2: 1 mesiac < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace Skupina splatností 3: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov Skupina splatností 4: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok Skupina splatností 5: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky Skupina splatností 6: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
„Multimenové swapy“ na infláciu alebo „krížové menové swapy“ a futures/forwardy/opcie na „multimenové swapy“ na infláciu alebo „krížové menové swapy“ swap alebo futures/forward/opcia na swap, kde si dve strany vymieňajú peňažné toky denominované v rôznych menách a peňažné toky aspoň jednej časti sú určené mierou inflácie **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP alebo FONS alebo FWOS alebo OPTS RTS2#16 = IFMC	Podtrieda multimenových swapov na infláciu je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#13 a RTS23#42) – menový pár, v ktorom je uvedená pomyselná hodnota, vymedzený ako kombinácia dvoch mien, v ktorých sú denominované dve časti swapu **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti swapu vymedzená takto: Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 mesiac Skupina splatností 2: 1 mesiac < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace Skupina splatností 3: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov Skupina splatností 4: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok Skupina splatností 5: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky Skupina splatností 6: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
„Swapy na jednu menu“ pevnej na pohyblivú úrokovú sadzbu a futures/forwardy/opcie na „swapy na jednu menu“ pevnej na pohyblivú úrokovú sadzbu swap alebo futures/forward/opcia na swap, kde si dve strany vymieňajú peňažné toky denominované v tej istej mene a peňažné toky jednej časti sú určené pevnou úrokovou sadzbou, zatiaľ čo peňažné toky druhej časti sú určené pohyblivou úrokovou sadzbou **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP alebo FONS alebo FWOS alebo OPTS RTS2#16 = XFSC	Podtrieda swapov na jednu menu pevnej na pohyblivú úrokovú sadzbu je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#13) – mena, v ktorej je uvedená pomyselná hodnota, v ktorej sú denominované dve časti swapu **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti swapu vymedzená takto: Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 mesiac Skupina splatností 2: 1 mesiac < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace Skupina splatností 3: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov Skupina splatností 4: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok Skupina splatností 5: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky Skupina splatností 6: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
„Swapy na jednu menu“ s pohyblivými úrokovými sadzbami a futures/forwardy/opcie na „swapy na jednu menu“ s pohyblivými úrokovými sadzbami swap alebo futures/forward/opcia na swap, kde si dve strany vymieňajú peňažné toky denominované v tej istej mene a kde sú peňažné toky oboch častí určené pohyblivými úrokovými sadzbami RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP alebo FONS alebo FWOS alebo OPTS RTS2#16 = FFSC	Podtrieda swapov na jednu menu s pohyblivými úrokovými sadzbami je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#13) – mena, v ktorej je uvedená pomyselná hodnota, v ktorej sú denominované dve časti swapu **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti swapu vymedzená takto: Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 mesiac Skupina splatností 2: 1 mesiac < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace Skupina splatností 3: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov Skupina splatností 4: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok Skupina splatností 5: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky Skupina splatností 6: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
„Swapy na jednu menu“ s pevnými úrokovými sadzbami a futures/forwardy/opcie na „swapy na jednu menu“ s pevnými úrokovými sadzbami swap alebo futures/forward/opcia na swap, kde si dve strany vymieňajú peňažné toky denominované v tej istej mene a kde sú peňažné toky oboch častí určené pevnými úrokovými sadzbami RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP alebo FONS alebo FWOS alebo OPTS RTS2#16 = XXSC	Podtrieda swapov na jednu menu s pevnými úrokovými sadzbami je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#13) – mena, v ktorej je uvedená pomyselná hodnota, v ktorej sú denominované dve časti swapu **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti swapu vymedzená takto: Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 mesiac Skupina splatností 2: 1 mesiac < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace Skupina splatností 3: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov Skupina splatností 4: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok Skupina splatností 5: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky Skupina splatností 6: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
„Jednodňový indexový swap (OIS)“ na „swapy na jednu menu“ a futures/forwardy/opcie na jednodňový indexový swap (OIS) na „swapy na jednu menu“ swap alebo futures/forward/opcia na swap, kde si dve strany vymieňajú peňažné toky denominované v tej istej mene a peňažné toky aspoň jednej časti sú určené sadzbou jednodňového indexového swapu (OIS) **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP alebo FONS alebo FWOS alebo OPTS RTS2#16 = OSSC	Podtrieda jednodňového indexového swapu (OIS) na swapy na jednu menu je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#13) – mena, v ktorej je uvedená pomyselná hodnota, v ktorej sú denominované dve časti swapu **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti swapu vymedzená takto: Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 mesiac Skupina splatností 2: 1 mesiac < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace Skupina splatností 3: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov Skupina splatností 4: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok Skupina splatností 5: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky Skupina splatností 6: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**Dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**
„Swapy na jednu menu“ na infláciu a futures/forwardy/opcie na „swapy na jednu menu“ na infláciu swap alebo futures/forward/opcia na swap, kde si dve strany vymieňajú peňažné toky denominované v tej istej mene a peňažné toky aspoň jednej časti sú určené mierou inflácie **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP alebo FONS alebo FWOS alebo OPTS RTS2#16 = IFSC	Podtrieda swapov na jednu menu na infláciu je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#13) – mena, v ktorej je uvedená pomyselná hodnota, v ktorej sú denominované dve časti swapu **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti swapu vymedzená takto: Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 mesiac Skupina splatností 2: 1 mesiac < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace Skupina splatností 3: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov Skupina splatností 4: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok Skupina splatností 5: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky Skupina splatností 6: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Trieda aktív – úrokové deriváty	
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa uplatňuje nasledujúca metodika**
Iné úrokové deriváty úrokový derivát, ktorý nepatrí do žiadnej z vyššie uvedených podtried aktív **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = OTHR	akýkoľvek iný úrokový derivát sa považuje za derivát, pre ktorý neexistuje likvidný trh

▼M4

Tabuľka 5.2.

Úrokové deriváty – predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh

Trieda aktív – úrokové deriváty									
Podtrieda aktív	**Percentily a spodné prahové hodnoty, ktoré sa majú použiť pre výpočet predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS pre každú podtriedu, pre ktorú sa určilo, že pre ňu existuje likvidný trh**								
	Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt	**Predobchodná LIS**		**Poobchodná SSTI**			**Poobchodná LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**
Dlhopisové futures/forwardy	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	5 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
Opcie na dlhopisy	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	5 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
Úrokové futures a FRA	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	10 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – úrokové deriváty									
Podtrieda aktív	**Percentily a spodné prahové hodnoty, ktoré sa majú použiť pre výpočet predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS pre každú podtriedu, pre ktorú sa určilo, že pre ňu existuje likvidný trh**								
	Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt	**Predobchodná LIS**		**Poobchodná SSTI**			**Poobchodná LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**
Úrokové opcie	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	10 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
Swapcie	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
„Multimenové swapy“ pevnej na pohyblivú úrokovú sadzbu alebo „krížové menové swapy“ a futures/forwardy na „multimenové swapy“ pevnej na pohyblivú úrokovú sadzbu alebo „krížové menové swapy“	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – úrokové deriváty									
Podtrieda aktív	**Percentily a spodné prahové hodnoty, ktoré sa majú použiť pre výpočet predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS pre každú podtriedu, pre ktorú sa určilo, že pre ňu existuje likvidný trh**								
	Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt	**Predobchodná LIS**		**Poobchodná SSTI**			**Poobchodná LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**
„Multimenové swapy“ s pohyblivými úrokovými sadzbami alebo „krížové menové swapy“ a futures/forwardy na „multimenové swapy“ s pohyblivými úrokovými sadzbami alebo „krížové menové swapy“	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
„Multimenové swapy“ s pevnými úrokovými sadzbami alebo „krížové menové swapy“ a futures/forwardy na „multimenové swapy“ s pevnými úrokovými sadzbami alebo „krížové menové swapy“	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – úrokové deriváty									
Podtrieda aktív	**Percentily a spodné prahové hodnoty, ktoré sa majú použiť pre výpočet predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS pre každú podtriedu, pre ktorú sa určilo, že pre ňu existuje likvidný trh**								
	Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt	**Predobchodná LIS**		**Poobchodná SSTI**			**Poobchodná LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**
„Jednodňový indexový swap (OIS)“ na „multimenové swapy“ alebo „krížové menové swapy“ a futures/forwardy na „jednodňový indexový swap (OIS)“ na „multimenové swapy“ alebo „krížové menové swapy“	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
„Multimenové swapy“ na infláciu alebo „krížové menové swapy“ a futures/forwardy na „multimenové swapy“ na infláciu alebo „krížové menové swapy“	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
„Swapy na jednu menu“ pevnej na pohyblivú úrokovú sadzbu a futures/forwardy na „swapy na jednu menu“ pevnej na pohyblivú úrokovú sadzbu	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – úrokové deriváty									
Podtrieda aktív	**Percentily a spodné prahové hodnoty, ktoré sa majú použiť pre výpočet predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS pre každú podtriedu, pre ktorú sa určilo, že pre ňu existuje likvidný trh**								
	Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt	**Predobchodná LIS**		**Poobchodná SSTI**			**Poobchodná LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**
„Swapy na jednu menu“ s pohyblivými úrokovými sadzbami a futures/forwardy na „swapy na jednu menu“ s pohyblivými úrokovými sadzbami	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
„Swapy na jednu menu“ s pevnými úrokovými sadzbami a futures/forwardy na „swapy na jednu menu“ s pevnými úrokovými sadzbami	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
„Jednodňový indexový swap (OIS)“ na „swapy na jednu menu“ a futures/forwardy na jednodňový indexový swap (OIS) na „swapy na jednu menu“	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – úrokové deriváty									
Podtrieda aktív	**Percentily a spodné prahové hodnoty, ktoré sa majú použiť pre výpočet predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS pre každú podtriedu, pre ktorú sa určilo, že pre ňu existuje likvidný trh**								
	Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt	**Predobchodná LIS**		**Poobchodná SSTI**			**Poobchodná LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**
„Swapy na jednu menu“ na infláciu a futures/forwardy na „swapy na jednu menu“ na infláciu	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

Tabuľka 5.3.

Úrokové deriváty – predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne neexistuje likvidný trh

Trieda aktív – úrokové deriváty			
Podtrieda aktív	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre každú podtriedu, pre ktorú sa určilo, že pre ňu neexistuje likvidný trh**		
	Predobchodná LIS	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Dlhopisové futures/forwardy	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Opcie na dlhopisy	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Úrokové futures a FRA	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – úrokové deriváty			
Podtrieda aktív	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre každú podtriedu, pre ktorú sa určilo, že pre ňu neexistuje likvidný trh**		
	Predobchodná LIS	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Úrokové opcie	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Swapcie	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Multimenové swapy“ pevnej na pohyblivú úrokovú sadzbu alebo „krížové menové swapy“ a futures/forwardy na „multimenové swapy“ pevnej na pohyblivú úrokovú sadzbu alebo „krížové menové swapy“	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Multimenové swapy“ s pohyblivými úrokovými sadzbami alebo „krížové menové swapy“ a futures/forwardy na „multimenové swapy“ s pohyblivými úrokovými sadzbami alebo „krížové menové swapy“	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Multimenové swapy“ s pevnými úrokovými sadzbami alebo „krížové menové swapy“ a futures/forwardy na „multimenové swapy“ s pevnými úrokovými sadzbami alebo „krížové menové swapy“	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Jednodňový indexový swap (OIS)“ na „multimenové swapy“ alebo „krížové menové swapy“ a futures/forwardy na „jednodňový indexový swap (OIS)“ na „multimenové swapy“ alebo „krížové menové swapy“	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Multimenové swapy“ na infláciu alebo „krížové menové swapy“ a futures/forwardy na „multimenové swapy“ na infláciu alebo „krížové menové swapy“	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Swapy na jednu menu“ pevnej na pohyblivú úrokovú sadzbu a futures/forwardy na „swapy na jednu menu“ pevnej na pohyblivú úrokovú sadzbu	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – úrokové deriváty			
Podtrieda aktív	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre každú podtriedu, pre ktorú sa určilo, že pre ňu neexistuje likvidný trh**		
	Predobchodná LIS	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
„Swapy na jednu menu“ s pohyblivými úrokovými sadzbami a futures/forwardy na „swapy na jednu menu“ s pohyblivými úrokovými sadzbami	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Swapy na jednu menu“ s pevnými úrokovými sadzbami a futures/forwardy na „swapy na jednu menu“ s pevnými úrokovými sadzbami	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Jednodňový indexový swap (OIS)“ na „swapy na jednu menu“ a futures/forwardy na jednodňový indexový swap (OIS) na „swapy na jednu menu“	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Swapy na jednu menu“ na infláciu a futures/forwardy na „swapy na jednu menu“ na infláciu	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Iné úrokové deriváty	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR

▼B

6. **Akciové deriváty**

▼M3

Tabuľka 6.1.

Akciové deriváty – triedy, pre ktoré neexistuje likvidný trh

Trieda aktív – akciové deriváty
akákoľvek zmluva v zmysle vymedzenia v prílohe I oddiele C bode 4 smernice 2014/65/EÚ týkajúca sa:
a) jednej alebo viacerých akcií, vkladových potvrdeniek, ETF, certifikátov, iných podobných finančných nástrojov, peňažných tokov alebo iných produktov týkajúcich sa výkonnosti jednej alebo viacerých akcií, vkladových potvrdeniek, ETF, certifikátov alebo iných podobných finančných nástrojov;
b) indexu akcií, vkladových potvrdeniek, ETF, certifikátov, iných podobných finančných nástrojov, peňažných tokov alebo iných produktov týkajúcich sa výkonnosti jednej alebo viacerých akcií, vkladových potvrdeniek, ETF, certifikátov alebo iných podobných finančných nástrojov.

▼M3

Trieda aktív – akciové deriváty	
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa uplatňuje nasledujúca metodika**
Opcie na akciový index opcia, ktorej podkladovým nástrojom je index zložený z akcií RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = STIX RTS23#26 alebo v prípade nulitnej hodnoty RTS23#28	všetky indexové opcie sa považujú za opcie, pre ktoré existuje likvidný trh
Futures/forwardy na akciový index futures/forward, ktorých podkladovým nástrojom je index zložený z akcií RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR alebo FORW RTS2#27 = STIX RTS23#26 alebo v prípade nulitnej hodnoty RTS23#28	všetky indexové futures/forwardy sa považujú za futures/forwardy, pre ktoré existuje likvidný trh
Akciové opcie opcia, ktorej podkladovým nástrojom je akcia alebo kôš akcií vyplývajúci z korporátnej udalosti RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = SHRS RTS23#26 alebo v prípade nulitnej hodnoty RTS23#28	všetky akciové opcie sa považujú za opcie, pre ktoré existuje likvidný trh

▼M3

Trieda aktív – akciové deriváty	
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa uplatňuje nasledujúca metodika**
Akciové futures/forwardy futures/forward, ktorých podkladovým nástrojom je akcia alebo kôš akcií vyplývajúci z korporátnej udalosti RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR alebo FORW RTS2#27 = SHRS RTS23#26 alebo v prípade nulitnej hodnoty RTS23#28	všetky akciové futures/forwardy sa považujú za futures/forwardy, pre ktoré existuje likvidný trh
Opcie na akciové dividendy opcia na dividendu konkrétnej akcie RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = DVSE RTS23#26 alebo v prípade nulitnej hodnoty RTS23#28	všetky opcie na akciové dividendy sa považujú za opcie, pre ktoré existuje likvidný trh
Futures/forwardy na akciové dividendy futures/forward na dividendu konkrétnej akcie RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR alebo FORW RTS2#27 = DVSE RTS23#26 alebo v prípade nulitnej hodnoty RTS23#28	všetky futures/forwardy na akciové dividendy sa považujú za futures/forwardy, pre ktoré existuje likvidný trh

▼M3

Trieda aktív – akciové deriváty	
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa uplatňuje nasledujúca metodika**
Opcie na dividendový index opcia na index zložený z dividend viac než jednej akcie RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = DIVI RTS23#26 alebo v prípade nulitnej hodnoty RTS23#28	všetky opcie na dividendový index sa považujú za opcie, pre ktoré existuje likvidný trh
Futures/forwardy na dividendový index futures/forward na index zložený z dividend viac než jednej akcie RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR alebo FORW RTS2#27 = DIVI RTS23#26 alebo v prípade nulitnej hodnoty RTS23#28	všetky futures/forwardy na dividendový index sa považujú za futures/forwardy, pre ktoré existuje likvidný trh
Opcie na index volatility opcia, ktorej podkladovým nástrojom je index volatility vymedzený ako index týkajúci sa volatility konkrétneho podkladového indexu kapitálových nástrojov RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = VOLI RTS23#26 alebo v prípade nulitnej hodnoty RTS23#28	všetky opcie na index volatility sa považujú za opcie, pre ktoré existuje likvidný trh

▼M3

Trieda aktív – akciové deriváty	
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa uplatňuje nasledujúca metodika**
Futures/forwardy na index volatility futures/forward, ktorých podkladovým nástrojom je index volatility vymedzený ako index týkajúci sa volatility konkrétneho podkladového indexu kapitálových nástrojov RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR alebo FORW RTS2#27 = VOLI RTS23#26 alebo v prípade nulitnej hodnoty RTS23#28	všetky futures/forwardy na index volatility sa považujú za futures/forwardy, pre ktoré existuje likvidný trh
Opcie na ETF opcia, ktorej podkladovým nástrojom je ETF RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = ETFS RTS23#26 alebo v prípade nulitnej hodnoty RTS23#28	všetky opcie na ETF sa považujú za opcie, pre ktoré existuje likvidný trh
Futures/forwardy na ETF futures/forward, ktorých podkladovým nástrojom je ETF RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR alebo FORW RTS2#27 = ETFS RTS23#26 alebo v prípade nulitnej hodnoty RTS23#28	všetky futures/forwardy na ETF sa považujú za futures/forwardy, pre ktoré existuje likvidný trh

▼M3

<table>
<tr><th colspan="5">Trieda aktív – akciové deriváty</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Podtrieda aktív</th><th colspan="3" rowspan="2">Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia</th><th colspan="2">Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity</th></tr>
<tr><th>Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]</th><th>Priemerný denný počet obchodov [kvantitatívne kritérium likvidity 2]</th></tr>
<tr><td>Swapy
RTS2#3 = DERV
RTS2#4 = EQUI
RTS2#5 = SWAP</td><td colspan="3">podtrieda swapov je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu:
Kritérium pre segmentáciu 1 (RTS2#27) – druh podkladového nástroja: jedna protistrana, index, kôš
Kritérium pre segmentáciu 2 (RTS23#26 alebo v prípade nulitnej hodnoty RTS23#28) – podkladová jedna protistrana, index, kôš
Kritérium pre segmentáciu 3 (RTS2#28) – parameter: základný výkonnostný parameter výnosu z ceny, parameter výnosu z dividend, parameter výnosu z rozdielu, parameter výnosu z volatility
Kritérium pre segmentáciu 4 (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti swapu vymedzená takto:
<table><tr><th>Základný výkonnostný parameter výnosu z ceny</th><th>Parameter výnosu z rozdielu/volatility</th><th>Parameter výnosu z dividend</th></tr><tr><td>Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 mesiac</td><td>Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace</td><td>Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 rok</td></tr><tr><td>Skupina splatností 2: 1 mesiac < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace</td><td>Skupina splatností 2: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov</td><td>Skupina splatností 2: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky</td></tr><tr><td>Skupina splatností 3: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov</td><td>Skupina splatností 3: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok</td><td>Skupina splatností 3: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky</td></tr><tr><td>Skupina splatností 4: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok</td><td>Skupina splatností 4: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky</td><td>…</td></tr></table></td><td>50 000 000 EUR</td><td></td></tr>
</table>

▼M3

<table>
<tr><td colspan="5">Trieda aktív – akciové deriváty</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Podtrieda aktív</td><td colspan="3" rowspan="2">Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia</td><td colspan="2">Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity</td></tr>
<tr><td>Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]</td><td>Priemerný denný počet obchodov [kvantitatívne kritérium likvidity 2]</td></tr>
<tr><td rowspan="4"></td><td>Skupina splatností 5: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky</td><td>Skupina splatností 5: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky</td><td>Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov</td><td rowspan="4"></td><td rowspan="4"></td></tr>
<tr><td>Skupina splatností 6: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky</td><td>…</td><td></td></tr>
<tr><td>…</td><td>Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov</td><td></td></tr>
<tr><td>Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>Portfóliové swapy
RTS2#3 = DERV
RTS2#4 = EQUI
RTS2#5 = PSWP</td><td colspan="3">podtrieda portfóliových swapov je vymedzená konkrétnou kombináciou:
Kritérium pre segmentáciu 1 (RTS2#27) – druh podkladového nástroja: jedna protistrana, index, kôš
Kritérium pre segmentáciu 2 (RTS23#26 alebo v prípade nulitnej hodnoty RTS23#28) – podkladová jedna protistrana, index, kôš
Kritérium pre segmentáciu 3 (RTS2#28) – parameter: základný výkonnostný parameter výnosu z ceny, parameter výnosu z dividend, parameter výnosu z rozdielu, parameter výnosu z volatility
Kritérium pre segmentáciu 4 (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti portfóliového swapu vymedzená takto:
Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 mesiac
Skupina splatností 2: 1 mesiac < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace
Skupina splatností 3: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov
Skupina splatností 4: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok
Skupina splatností 5: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky
Skupina splatností 6: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky
…
Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov</td><td>50 000 000 EUR</td><td>15</td></tr>
</table>

▼M3

Trieda aktív – akciové deriváty	
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa uplatňuje nasledujúca metodika**
Iné akciové deriváty akciový derivát, ktorý nepatrí do žiadnej z vyššie uvedených podtried aktív RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OTHR“	akýkoľvek iný akciový derivát sa považuje za derivát, pre ktorý neexistuje likvidný trh

▼M4

Tabuľka 6.2.

Akciové deriváty – predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh

Trieda aktív – akciové deriváty						
Podtrieda aktív	**Na účely určenia predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS sa každá podtrieda aktív ďalej segmentuje na podtriedy podľa vymedzenia nižšie**	**Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt**	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS určené pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh na základe pásma priemernej dennej pomyselnej hodnoty (ADNA), do ktorého daná podtrieda patrí**			
			Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA)	**Predobchodná LIS**	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
				Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Opcie na akciový index	Podtrieda opcie na akciový index je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** – podkladový akciový index	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	< 100 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mil. EUR ≤ ADNA < 600 mil. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 mil. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – akciové deriváty						
Podtrieda aktív	**Na účely určenia predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS sa každá podtrieda aktív ďalej segmentuje na podtriedy podľa vymedzenia nižšie**	**Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt**	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS určené pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh na základe pásma priemernej dennej pomyselnej hodnoty (ADNA), do ktorého daná podtrieda patrí**			
			Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA)	**Predobchodná LIS**	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
				Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Futures/forwardy na akciový index	Podtrieda futures/forwardy na akciový index je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** – podkladový akciový index	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	< 100 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 1 mld. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mld. EUR ≤ ADNA < 3 mld. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mld. EUR ≤ ADNA < 5 mld. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 mld. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Akciové opcie	Podtrieda akciové opcie je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** – podkladová akcia	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	< 5 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – akciové deriváty						
Podtrieda aktív	**Na účely určenia predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS sa každá podtrieda aktív ďalej segmentuje na podtriedy podľa vymedzenia nižšie**	**Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt**	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS určené pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh na základe pásma priemernej dennej pomyselnej hodnoty (ADNA), do ktorého daná podtrieda patrí**			
			Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA)	**Predobchodná LIS**	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
				Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Akciové futures/ forwardy	Podtrieda akciové futures/forwardy je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** – podkladová akcia	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	< 5 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
Opcie na akciové dividendy	Podtrieda opcie na akciové dividendy je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** – podkladová akcia s nárokom na dividendy	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	< 5 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – akciové deriváty						
Podtrieda aktív	**Na účely určenia predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS sa každá podtrieda aktív ďalej segmentuje na podtriedy podľa vymedzenia nižšie**	**Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt**	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS určené pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh na základe pásma priemernej dennej pomyselnej hodnoty (ADNA), do ktorého daná podtrieda patrí**			
			Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA)	**Predobchodná LIS**	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
				Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Futures/forwardy na akciové dividendy	Podtrieda futures/forwardy na akciové dividendy je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** – podkladová akcia s nárokom na dividendy	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	< 5 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR
Opcie na dividendový index	Podtrieda opcie na dividendový index je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** – podkladový dividendový index	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	< 100 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mil. EUR ≤ ADNA < 600 mil. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 mil. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – akciové deriváty						
Podtrieda aktív	**Na účely určenia predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS sa každá podtrieda aktív ďalej segmentuje na podtriedy podľa vymedzenia nižšie**	**Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt**	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS určené pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh na základe pásma priemernej dennej pomyselnej hodnoty (ADNA), do ktorého daná podtrieda patrí**			
			Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA)	**Predobchodná LIS**	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
				Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Futures/forwardy na dividendový index	Podtrieda futures/forwardy na dividendový index je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** – podkladový dividendový index	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	< 100 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 1 mld. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mld. EUR ≤ ADNA < 3 mld. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mld. EUR ≤ ADNA < 5 mld. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 mld. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Opcie na index volatility	Podtrieda opcie na index volatility je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** – podkladový index volatility	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	< 100 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mil. EUR ≤ ADNA < 600 mil. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 mil. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – akciové deriváty						
Podtrieda aktív	**Na účely určenia predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS sa každá podtrieda aktív ďalej segmentuje na podtriedy podľa vymedzenia nižšie**	**Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt**	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS určené pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh na základe pásma priemernej dennej pomyselnej hodnoty (ADNA), do ktorého daná podtrieda patrí**			
			Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA)	**Predobchodná LIS**	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
				Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Futures/forwardy na index volatility	Podtrieda futures/forwardy na index volatility je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** – podkladový index volatility	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	< 100 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 1 mld. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mld. EUR ≤ ADNA < 3 mld. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mld. EUR ≤ ADNA < 5 mld. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 mld. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Opcie na ETF	Podtrieda opcie na ETF je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** – podkladový ETF	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	< 5 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – akciové deriváty						
Podtrieda aktív	**Na účely určenia predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS sa každá podtrieda aktív ďalej segmentuje na podtriedy podľa vymedzenia nižšie**	**Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt**	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS určené pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh na základe pásma priemernej dennej pomyselnej hodnoty (ADNA), do ktorého daná podtrieda patrí**			
			Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA)	**Predobchodná LIS**	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
				Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Futures/forwardy na ETF	Podtrieda futures/forwardy na ETF je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** – podkladový ETF	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	< 5 mil. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
Swapy	Podtrieda swapy je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** – druh podkladového nástroja: jedna protistrana, index, kôš **Kritérium pre segmentáciu 2** – podkladová jedna protistrana, index, kôš **Kritérium pre segmentáciu 3** – parameter: základný výkonnostný parameter výnosu z ceny, parameter výnosu z dividend, parameter výnosu z rozdielu, parameter výnosu z volatility **Kritérium pre segmentáciu 4** – čas do skupiny splatností swapu vymedzený takto:	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	50 mil. EUR ≤ ADNA < 100 mil. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 200 mil. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – akciové deriváty								
Podtrieda aktív	**Na účely určenia predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS sa každá podtrieda aktív ďalej segmentuje na podtriedy podľa vymedzenia nižšie**			**Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt**	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS určené pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh na základe pásma priemernej dennej pomyselnej hodnoty (ADNA), do ktorého daná podtrieda patrí**			
					Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA)	**Predobchodná LIS**	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
						Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
	Základný výkonnostný parameter výnosu z ceny	Parameter výnosu z rozdielu/volatility	Parameter výnosu z dividend					
	Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 mesiac	**Skupina splatností 1:** 0 < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace	**Skupina splatností 1:** 0 < čas do splatnosti ≤ 1 rok					
	Skupina splatností 2: 1 mesiac < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace	**Skupina splatností 2:** 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov	**Skupina splatností 2:** 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky					
	Skupina splatností 3: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov	**Skupina splatností 3:** 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok	**Skupina splatností 3:** 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky					
	Skupina splatností 4: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok	**Skupina splatností 4:** 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky	…					

▼M4

Trieda aktív – akciové deriváty								
Podtrieda aktív	**Na účely určenia predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS sa každá podtrieda aktív ďalej segmentuje na podtriedy podľa vymedzenia nižšie**			**Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt**	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS určené pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh na základe pásma priemernej dennej pomyselnej hodnoty (ADNA), do ktorého daná podtrieda patrí**			
					Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA)	**Predobchodná LIS**	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
						Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
	Skupina splatností 5: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky	**Skupina splatností 5:** 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky	**Skupina splatností *m:*** (*n*-1) rokov < čas do splatnosti ≤ *n* rokov					
	Skupina splatností 6: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky	…						
	…	**Skupina splatností *m:*** (*n*-1) rokov < čas do splatnosti ≤ *n* rokov						
	Skupina splatností *m*: (*n*-1) rokov < čas do splatnosti ≤ *n* rokov							
Portfóliové swapy	Podtrieda portfóliové swapy je vymedzená konkrétnou kombináciou: **Kritérium pre segmentáciu 1** – druh podkladového nástroja: jedna protistrana, index, kôš **Kritérium pre segmentáciu 2** – podkladová jedna protistrana, index, kôš **Kritérium pre segmentáciu 3** – parameter: základný výkonnostný parameter výnosu z ceny, parameter výnosu z dividend, parameter výnosu z rozdielu, parameter výnosu z volatility **Kritérium pre segmentáciu 4** – čas do skupiny splatností portfóliového swapu vymedzený takto:			výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	50 mil. EUR ≤ ADNA < 100 mil. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
					100 mil. EUR ≤ADNA < 200 mil. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
					ADNA ≥ 200 mil. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – akciové deriváty						
Podtrieda aktív	**Na účely určenia predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS sa každá podtrieda aktív ďalej segmentuje na podtriedy podľa vymedzenia nižšie**	**Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt**	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS určené pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh na základe pásma priemernej dennej pomyselnej hodnoty (ADNA), do ktorého daná podtrieda patrí**			
			Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA)	**Predobchodná LIS**	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
				Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
	Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 mesiac **Skupina splatností 2:** 1 mesiac < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace **Skupina splatností 3:** 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov **Skupina splatností 4:** 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok **Skupina splatností 5:** 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky **Skupina splatností 6:** 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … **Skupina splatností *m*:** (*n*-1) rokov < čas do splatnosti ≤ *n* rokov					

Tabuľka 6.3.

Akciové deriváty – predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne neexistuje likvidný trh

Trieda aktív – akciové deriváty			
Podtrieda aktív	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne neexistuje likvidný trh**		
	Predobchodná LIS	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Swapy	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR
Portfóliové swapy	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR
Iné akciové deriváty	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR

▼B

7. **Komoditné deriváty**

▼M3

Tabuľka 7.1.

Komoditné deriváty – triedy, pre ktoré neexistuje likvidný trh

<table>
<tr><td colspan="4">Trieda aktív – komoditné deriváty</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Podtrieda aktív</td><td rowspan="2">Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia</td><td colspan="2">Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty</td></tr>
<tr><td>Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]</td><td>Priemerný denný počet obchodov [kvantitatívne kritérium likvidity 2]</td></tr>
<tr><td>Futures/forwardy na kovové komodity
RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „METL“ a [RTS2#5 = „FUTR“ alebo „FORW“]</td><td>podtrieda futures/forwardov na kovové komodity je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu:
Kritérium pre segmentáciu 1 (RTS23#36) – druh kovu: drahé kovy, bežné kovy
Kritérium pre segmentáciu 2 (RTS23#37) – podkladový kov
Kritérium pre segmentáciu 3 (RTS2#15) – mena, v ktorej je uvedená pomyselná hodnota, vymedzená ako mena, v ktorej je denominovaná pomyselná hodnota futures/forwardu
Kritérium pre segmentáciu 4 (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti futures/forwardov vymedzená takto:
<table>
<tr><th>Drahé kovy</th><th>Bežné kovy</th></tr>
<tr><td>Skupina splatností 1:
0 < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace</td><td>Skupina splatností 1:
0 < čas do splatnosti ≤ 1 rok</td></tr>
<tr><td>Skupina splatností 2:
3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 1 rok</td><td>Skupina splatností 2:
1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky</td></tr>
<tr><td>Skupina splatností 3:
1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky</td><td>Skupina splatností 3:
2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky</td></tr>
</table></td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
</table>

▼M3

Trieda aktív – komoditné deriváty				
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**		**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty**	
			Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]
	Skupina splatností 4: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky	…		
	…	**Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov		
	Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov			
Opcie na kovové komodity RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „METL“ a RTS2#5 = „OPTN“	Podtrieda opcií na kovové komodity je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#36) – druh kovu: drahé kovy, bežné kovy **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS23#37) – podkladový kov **Kritérium pre segmentáciu 3** (RTS2#15) – mena, v ktorej je uvedená pomyselná hodnota, vymedzená ako mena, v ktorej je denominovaná pomyselná hodnota opcie **Kritérium pre segmentáciu 4** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti opcie vymedzená takto:		10 000 000 EUR	10
	Drahé kovy	**Bežné kovy**		
	Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace	**Skupina splatností 1**: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 rok		
	Skupina splatností 2: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 1 rok	**Skupina splatností 2**: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky		

▼M3

<table>
<tr><td colspan="4">Trieda aktív – komoditné deriváty</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Podtrieda aktív</td><td colspan="2" rowspan="2">Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia</td><td colspan="2">Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty</td></tr>
<tr><td>Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]</td><td>Priemerný denný počet obchodov [kvantitatívne kritérium likvidity 2]</td></tr>
<tr><td></td><td>Skupina splatností 3:
1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky</td><td>Skupina splatností 3:
2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky</td><td rowspan="4"></td><td rowspan="4"></td></tr>
<tr><td></td><td>Skupina splatností 4:
2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky</td><td>…</td></tr>
<tr><td></td><td>…</td><td>Skupina splatností m:
(n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov</td></tr>
<tr><td></td><td>Skupina splatností m:
(n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov</td><td></td></tr>
<tr><td>Swapy kovových komodít
RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „METL“ a RTS2#5 = „SWAP“</td><td colspan="2">Podtrieda swapov kovových komodít je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu:
Kritérium pre segmentáciu 1 (RTS23#36) – druh kovu: drahé kovy, bežné kovy
Kritérium pre segmentáciu 2 (RTS23#37) – podkladový kov
Kritérium pre segmentáciu 3 (RTS2#15) – mena, v ktorej je uvedená pomyselná hodnota, vymedzená ako mena, v ktorej je denominovaná pomyselná hodnota swapu
Kritérium pre segmentáciu 4 (RTS23#34) – druh dodania vymedzený ako hotovostné, fyzické alebo iné
Kritérium pre segmentáciu 5 (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti swapu vymedzená takto:</td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
<tr><td></td><td>Drahé kovy</td><td>Bežné kovy</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Skupina splatností 1:
0 < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace</td><td>Skupina splatností 1:
0 < čas do splatnosti ≤ 1 rok</td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

Trieda aktív – komoditné deriváty				
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**		**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty**	
			Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]
	Skupina splatností 2: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 1 rok	**Skupina splatností 2**: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky		
	Skupina splatností 3: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky	**Skupina splatností 3**: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky		
	Skupina splatností 4: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky	…		
	…	**Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov		
	Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov			
Futures/forwardy na energetické komodity RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „NRGY“ a [RTS2#5 = „FUTR“ alebo „FORW“]	Podtrieda futures/forwardov na energetické komodity je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#36) – druh energie: ropa, ropné destiláty, uhlie, ľahké ropné frakcie, zemný plyn, elektrina, inter-energia **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS23#37) – podkladová energia **Kritérium pre segmentáciu 3** (RTS2#15) – mena, v ktorej je uvedená pomyselná hodnota, vymedzená ako mena, v ktorej je denominovaná pomyselná hodnota futures/forwardu **Kritérium pre segmentáciu 4** – [vypúšťa sa]		10 000 000 EUR	10

▼M3

<table>
<tr><td colspan="5">Trieda aktív – komoditné deriváty</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Podtrieda aktív</td><td colspan="3" rowspan="2">Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia</td><td colspan="2">Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty</td></tr>
<tr><td>Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]</td><td>Priemerný denný počet obchodov [kvantitatívne kritérium likvidity 2]</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="3">Kritérium pre segmentáciu 5 (RTS2#14) – miesto dodania/hotovostného vyrovnania použiteľné na všetky druhy energie
Kritérium pre segmentáciu 6 (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti futures/forwardov vymedzená takto:</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Ropa/ropné destiláty/ľahké ropné frakcie</td><td>Uhlie</td><td>Zemný plyn/elektrina/inter-energia</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Skupina splatností 1:
0 < čas do splatnosti ≤ 4 mesiace</td><td>Skupina splatností 1:
0 < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov</td><td>Skupina splatností 1:
0 < čas do splatnosti ≤ 1 mesiac</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Skupina splatností 2:
4 mesiace < čas do splatnosti ≤ 8 mesiacov</td><td>Skupina splatností 2:
6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok</td><td>Skupina splatností 2:
1 mesiac < čas do splatnosti ≤ 1 rok</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Skupina splatností 3:
8 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok</td><td>Skupina splatností 3:
1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky</td><td>Skupina splatností 3:
1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Skupina splatností 4:
1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky</td><td>…</td><td>…</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>…</td><td>Skupina splatností m:
(n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov</td><td>Skupina splatností m:
(n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>Skupina splatností m:
(n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov</td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

<table>
<tr><th colspan="4">Trieda aktív – komoditné deriváty</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Podtrieda aktív</th><th rowspan="2">Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia</th><th colspan="2">Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty</th></tr>
<tr><th>Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]</th><th>Priemerný denný počet obchodov [kvantitatívne kritérium likvidity 2]</th></tr>
<tr><td>Opcie na energetické komodity
RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „NRGY“ a RTS2#5 = „OPTN“</td><td>Podtrieda opcií na energetické komodity je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu:
Kritérium pre segmentáciu 1 (RTS23#36) – druh energie: ropa, ropné destiláty, uhlie, ľahké ropné frakcie, zemný plyn, elektrina, inter-energia
Kritérium pre segmentáciu 2 (RTS23#37) – podkladová energia
Kritérium pre segmentáciu 3 (RTS2#15) – mena, v ktorej je uvedená pomyselná hodnota, vymedzená ako mena, v ktorej je denominovaná pomyselná hodnota opcie
Kritérium pre segmentáciu 4 – [vypúšťa sa]
Kritérium pre segmentáciu 5 (RTS2#14) – miesto dodania/hotovostného vyrovnania použiteľné na všetky druhy energie
Kritérium pre segmentáciu 6 (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti opcie vymedzená takto:
<table>
<tr><th>Ropa/ropné destiláty/ľahké ropné frakcie</th><th>Uhlie</th><th>Zemný plyn/elektrina/inter-energia</th></tr>
<tr><td>Skupina splatností 1:
0 < čas do splatnosti ≤ 4 mesiace</td><td>Skupina splatností 1:
0 < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov</td><td>Skupina splatností 1:
0 < čas do splatnosti ≤ 1 mesiac</td></tr>
<tr><td>Skupina splatností 2: 4 mesiace < čas do splatnosti ≤ 8 mesiacov</td><td>Skupina splatností 2: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok</td><td>Skupina splatností 2: 1 mesiac < čas do splatnosti ≤ 1 rok</td></tr>
</table></td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
</table>

▼M3

Trieda aktív – komoditné deriváty					
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**			**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty**	
				Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]
	Skupina splatností 3: 8 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok	**Skupina splatností 3**: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky	**Skupina splatností 3**: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky		
	Skupina splatností 4: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky	…	…		
	…	**Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	**Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov		
	Skupina splatností m: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov				
Swapy energetických komodít RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „NRGY“ a RTS2#5 = „SWAP“	Podtrieda swapov energetických komodít je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#36) – druh energie: ropa, ropné destiláty, uhlie, ľahké ropné frakcie, zemný plyn, elektrina, inter-energia **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS23#37) – podkladová energia **Kritérium pre segmentáciu 3** (RTS2#15) – mena, v ktorej je uvedená pomyselná hodnota, vymedzená ako mena, v ktorej je denominovaná pomyselná hodnota swapu **Kritérium pre segmentáciu 4** (RTS23#34) – druh dodania vymedzený ako hotovostné, fyzické alebo iné **Kritérium pre segmentáciu 5** – [vypúšťa sa] **Kritérium pre segmentáciu 6** (RTS2#14) – miesto dodania/hotovostného vyrovnania použiteľné na všetky druhy energie **Kritérium pre segmentáciu 7** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti swapu vymedzená takto:			10 000 000 EUR	10

▼M3

<table>
<tr><th colspan="5">Trieda aktív – komoditné deriváty</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Podtrieda aktív</th><th colspan="3" rowspan="2">Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia</th><th colspan="2">Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty</th></tr>
<tr><th>Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]</th><th>Priemerný denný počet obchodov [kvantitatívne kritérium likvidity 2]</th></tr>
<tr><td rowspan="7"></td><td>Ropa/ropné destiláty/ľahké ropné frakcie</td><td>Uhlie</td><td>Zemný plyn/elektrina/inter-energia</td><td rowspan="7"></td><td rowspan="7"></td></tr>
<tr><td>Skupina splatností 1:
0 < čas do splatnosti ≤ 4 mesiace</td><td>Skupina splatností 1:
0 < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov</td><td>Skupina splatností 1:
0 < čas do splatnosti ≤ 1 mesiac</td></tr>
<tr><td>Skupina splatností 2:
4 mesiace < čas do splatnosti ≤ 8 mesiacov</td><td>Skupina splatností 2:
6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok</td><td>Skupina splatností 2:
1 mesiac < čas do splatnosti ≤ 1 rok</td></tr>
<tr><td>Skupina splatností 3:
8 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok</td><td>Skupina splatností 3:
1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky</td><td>Skupina splatností 3:
1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky</td></tr>
<tr><td>Skupina splatností 4:
1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky</td><td>…</td><td>…</td></tr>
<tr><td>…</td><td>Skupina splatností m:
(n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov</td><td>Skupina splatností m:
(n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov</td></tr>
<tr><td>Skupina splatností m:
(n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>Futures/forwardy na poľnohospodárske komodity
RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „AGRI“ a [RTS2#5 = „FUTR“ alebo „FORW“]</td><td colspan="3">Podtrieda futures/forwardov na poľnohospodárske komodity je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu:
Kritérium pre segmentáciu 1 (RTS23#36 a RTS23#37) – podkladová poľnohospodárska komodita (podprodukt a ďalší podprodukt)
Kritérium pre segmentáciu 2 (RTS2#15) – mena, v ktorej je uvedená pomyselná hodnota, vymedzená ako mena, v ktorej je denominovaná pomyselná hodnota futures/forwardu</td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
</table>

▼M3

Trieda aktív – komoditné deriváty			
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty**	
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]
	Kritérium pre segmentáciu 3 (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti futures/forwardov vymedzená takto: **Skupina splatností 1**: 0 < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace **Skupina splatností 2**: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov **Skupina splatností 3**: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok **Skupina splatností 4**: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky … **Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov		
Opcie na poľnohospodárske komodity RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „AGRI“ a RTS2#5 = „OPTN“	Podtrieda opcií na poľnohospodárske komodity je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#36 a RTS23#37) – podkladová poľnohospodárska komodita (podprodukt a ďalší podprodukt) **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#15) – mena, v ktorej je uvedená pomyselná hodnota, vymedzená ako mena, v ktorej je denominovaná pomyselná hodnota opcie **Kritérium pre segmentáciu 3** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti opcie vymedzená takto: **Skupina splatností 1**: 0 < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace **Skupina splatností 2**: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov **Skupina splatností 3**: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok **Skupina splatností 4**: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky … **Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	10 000 000 EUR	10

▼M3

Trieda aktív – komoditné deriváty			
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty**	
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]
Swapy poľnohospodárskych komodít RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „AGRI“ a RTS2#5 = „SWAP“	Podtrieda swapov poľnohospodárskych komodít je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#36 a RTS23#37) – podkladová poľnohospodárska komodita (podprodukt a ďalší podprodukt) **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#15) – mena, v ktorej je uvedená pomyselná hodnota, vymedzená ako mena, v ktorej je denominovaná pomyselná hodnota swapu **Kritérium pre segmentáciu 3** (RTS23#34) – druh dodania vymedzený ako hotovostné, fyzické alebo iné **Kritérium pre segmentáciu 4** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti swapu vymedzená takto: **Skupina splatností 1**: 0 < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace **Skupina splatností 2**: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov **Skupina splatností 3**: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok **Skupina splatností 4**: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky … **Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	10 000 000 EUR	10
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa uplatňuje nasledujúca metodika**		
Iné komoditné deriváty komoditný derivát, ktorý nepatrí do žiadnej z vyššie uvedených podtried aktív	akýkoľvek iný komoditný derivát sa považuje za derivát, pre ktorý neexistuje likvidný trh		

▼M4

Tabuľka 7.2.

Komoditné deriváty – predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh

Trieda aktív – komoditné deriváty									
Podtrieda aktív	**Percentily a spodné prahové hodnoty, ktoré sa majú použiť pre výpočet predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh**								
	Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt	**Predobchodná LIS**		**Poobchodná SSTI**			**Poobchodná LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**
Futures/forwardy na kovové komodity	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Opcie na kovové komodity	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Swapy kovových komodít	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – komoditné deriváty									
Podtrieda aktív	**Percentily a spodné prahové hodnoty, ktoré sa majú použiť pre výpočet predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh**								
	Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt	**Predobchodná LIS**		**Poobchodná SSTI**			**Poobchodná LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**
Futures/forwardy na energetické komodity	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Opcie na energetické komodity	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Swapy energetických komodít	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – komoditné deriváty									
Podtrieda aktív	**Percentily a spodné prahové hodnoty, ktoré sa majú použiť pre výpočet predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh**								
	Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt	**Predobchodná LIS**		**Poobchodná SSTI**			**Poobchodná LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**
Futures/forwardy na poľnohospodárske komodity	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Opcie na poľnohospodárske komodity	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Swapy poľnohospodárskych komodít	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

▼M4

Tabuľka 7.3.

Komoditné deriváty – predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne neexistuje likvidný trh

Trieda aktív – komoditné deriváty			
Podtrieda aktív	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne neexistuje likvidný trh**		
	Predobchodná LIS	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Futures/forwardy na kovové komodity	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Opcie na kovové komodity	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Swapy kovových komodít	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Futures/forwardy na energetické komodity	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Opcie na energetické komodity	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Swapy energetických komodít	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Futures/forwardy na poľnohospodárske komodity	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Opcie na poľnohospodárske komodity	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Swapy poľnohospodárskych komodít	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Iné komoditné deriváty	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR

▼B

8. **Devízové deriváty**

▼M3

Tabuľka 8.1.

Devízové deriváty – triedy, pre ktoré neexistuje likvidný trh

Trieda aktív – devízové deriváty			
finančný nástroj týkajúci sa mien v zmysle vymedzenia v prílohe I oddiele C bode 4 smernice 2014/65/EÚ			
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity**	
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]
Forward bez fyzickej dodávky (non-deliverable forward, NDF) je forward, ktorý je podľa podmienok hotovostne vyrovnaný medzi protistranami, kde suma vyrovnania je určená rozdielom výmenného kurzu dvoch mien medzi dňom uzavretia obchodu a dňom ocenenia. K dátumu vyrovnania bude jedna strana druhej strane dlžiť čistý rozdiel medzi i) výmenným kurzom stanoveným ku dňu uzavretia obchodu; a ii) výmenným kurzom ku dňu ocenenia na základe pomyselnej hodnoty, pričom táto čistá suma bude splatná v mene vyrovnania stanovenej v zmluve. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FORW RTS2#26 = NDLV	podtrieda FX forwardu bez fyzickej dodávky je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#13 a RTS23#47) – podkladový menový pár vymedzený ako kombinácia dvoch mien tvoriacich podkladový nástroj zmluvy o derivátoch **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti forwardu vymedzená takto: **Skupina splatností 1**: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 týždeň **Skupina splatností 2**: 1 týždeň < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace **Skupina splatností 3**: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 1 rok **Skupina splatností 4**: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky **Skupina splatností 5**: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … **Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	Forward bez fyzickej dodávky (NDF) sa považuje za forward, pre ktorý neexistuje likvidný trh.	

▼M3

Trieda aktív – devízové deriváty			
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity**	
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]
Forward s fyzickou dodávkou (deliverable forward, DF) je forward, ktorý výlučne zahŕňa výmenu dvoch rôznych mien k určitému budúcemu dátumu vyrovnania stanovenému v zmluve za fixnú sadzbu dohodnutú pri uzavretí zmluvy vzťahujúcej sa na túto výmenu. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR“ RTS2#5 = FORW RTS2#26 = DLVB	Podtrieda FX forwardu s fyzickou dodávkou je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#13 a RTS23#47) – podkladový menový pár vymedzený ako kombinácia dvoch mien tvoriacich podkladový nástroj zmluvy o derivátoch **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti forwardu vymedzená takto: **Skupina splatností 1**: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 týždeň **Skupina splatností 2**: 1 týždeň < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace **Skupina splatností 3**: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 1 rok **Skupina splatností 4**: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky **Skupina splatností 5**: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … **Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	Forward s fyzickou dodávkou sa považuje za forward, pre ktorý neexistuje likvidný trh	

▼M3

Trieda aktív – devízové deriváty			
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity**	
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]
FX opcie bez fyzickej dodávky (non-deliverable FX options, NDO) je opcia, ktorá je podľa podmienok hotovostne vyrovnaná medzi protistranami, kde suma vyrovnania je určená rozdielom výmenného kurzu dvoch mien medzi dňom uzavretia obchodu a dňom ocenenia. K dátumu vyrovnania bude jedna strana druhej strane dlžiť čistý rozdiel medzi i) výmenným kurzom stanoveným ku dňu uzavretia obchodu; a ii) výmenným kurzom ku dňu ocenenia na základe pomyselnej hodnoty, pričom táto čistá suma bude splatná v mene vyrovnania stanovenej v zmluve. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR“ RTS2#5 = OPTN RTS2#26 = NDLV	podtrieda FX opcie bez fyzickej dodávky je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#13 a RTS23#47) – podkladový menový pár vymedzený ako kombinácia dvoch mien tvoriacich podkladový nástroj zmluvy o derivátoch **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti opcie vymedzená takto: **Skupina splatností 1**: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 týždeň **Skupina splatností 2**: 1 týždeň < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace **Skupina splatností 3**: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 1 rok **Skupina splatností 4**: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky **Skupina splatností 5**: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … **Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	FX opcie bez fyzickej dodávky sa považujú za opcie, pre ktoré neexistuje likvidný trh	

▼M3

Trieda aktív – devízové deriváty			
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity**	
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]
FX opcie s fyzickou dodávkou (deliverable FX options, DO) je opcia, ktorá výlučne zahŕňa výmenu dvoch rôznych mien k určitému budúcemu dátumu vyrovnania stanovenému v zmluve za fixnú sadzbu dohodnutú pri uzavretí zmluvy vzťahujúcej sa na túto výmenu. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = OPTN RTS2#26 = DLVB	Podtrieda FX opcie s fyzickou dodávkou je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#13 a RTS23#47) – podkladový menový pár vymedzený ako kombinácia dvoch mien tvoriacich podkladový nástroj zmluvy o derivátoch **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti opcie vymedzená takto: **Skupina splatností 1**: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 týždeň **Skupina splatností 2**: 1 týždeň < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace **Skupina splatností 3**: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 1 rok **Skupina splatností 4**: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky **Skupina splatností 5**: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … **Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	FX opcie s fyzickou dodávkou sa považujú za opcie, pre ktoré neexistuje likvidný trh	

▼M3

Trieda aktív – devízové deriváty			
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity**	
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]
FX swapy bez fyzickej dodávky (non-deliverable FX swaps, NDS) je swap, ktorý je podľa podmienok hotovostne vyrovnaný medzi protistranami, kde suma vyrovnania je určená rozdielom výmenného kurzu dvoch mien medzi dňom uzavretia obchodu a dňom ocenenia. K dátumu vyrovnania bude jedna strana druhej strane dlžiť čistý rozdiel medzi i) výmenným kurzom stanoveným ku dňu uzavretia obchodu; a ii) výmenným kurzom ku dňu ocenenia na základe pomyselnej hodnoty, pričom táto čistá suma bude splatná v mene vyrovnania stanovenej v zmluve. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR“** RTS2#5 = SWAP RTS2#26 = NDLV	podtrieda FX swapu bez fyzickej dodávky je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#13 a RTS23#47) – podkladový menový pár vymedzený ako kombinácia dvoch mien tvoriacich podkladový nástroj zmluvy o derivátoch **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti swapu vymedzená takto: **Skupina splatností 1**: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 týždeň **Skupina splatností 2**: 1 týždeň < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace **Skupina splatností 3**: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 1 rok **Skupina splatností 4**: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky **Skupina splatností 5**: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … **Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	FX swapy bez fyzickej dodávky sa považujú za swapy, pre ktoré neexistuje likvidný trh	

▼M3

Trieda aktív – devízové deriváty			
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity**	
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]
FX swapy s fyzickou dodávkou (deliverable FX swaps, DS) je swap, ktorý výlučne zahŕňa výmenu dvoch rôznych mien k určitému budúcemu dátumu vyrovnania stanovenému v zmluve za fixnú sadzbu dohodnutú pri uzavretí zmluvy vzťahujúcej sa na túto výmenu. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = SWAP RTS2#26 = DLVB	Podtrieda FX swapu s fyzickou dodávkou je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#13 a RTS23#47) – podkladový menový pár vymedzený ako kombinácia dvoch mien tvoriacich podkladový nástroj zmluvy o derivátoch **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti swapu vymedzená takto: **Skupina splatností 1**: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 týždeň **Skupina splatností 2**: 1 týždeň < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace **Skupina splatností 3**: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 1 rok **Skupina splatností 4**: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky **Skupina splatností 5**: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … **Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	FX swapy s fyzickou dodávkou (DS) sa považujú za swapy, pre ktoré neexistuje likvidný trh	

▼M3

Trieda aktív – devízové deriváty			
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity**	
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]
FX futurity **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR“** RTS2#5 = FUTR	Podtrieda FX futures je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#13 a RTS23#47) – podkladový menový pár vymedzený ako kombinácia dvoch mien tvoriacich podkladový nástroj zmluvy o derivátoch **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti futures vymedzená takto: **Skupina splatností 1**: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 týždeň **Skupina splatností 2**: 1 týždeň < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace **Skupina splatností 3**: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 1 rok **Skupina splatností 4**: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky **Skupina splatností 5**: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … **Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	FX futures sa považujú za futures, pre ktoré neexistuje likvidný trh	

Trieda aktív – devízové deriváty	
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa uplatňuje nasledujúca metodika**
Iné devízové deriváty FX derivát, ktorý nepatrí do žiadnej z vyššie uvedených podtried aktív RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = OTHR	akýkoľvek iný FX derivát sa považuje za derivát, pre ktorý neexistuje likvidný trh

▼M4

Tabuľka 8.2.

Devízové deriváty – predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne neexistuje likvidný trh

Trieda aktív – devízové deriváty			
Podtrieda aktív	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne neexistuje likvidný trh**		
	Predobchodná LIS	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Forward bez fyzickej dodávky (non-deliverable forward, NDF)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Forward s fyzickou dodávkou (deliverable forward, DF)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
FX opcie bez fyzickej dodávky (non-deliverable FX options, NDO)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
FX opcie s fyzickou dodávkou (deliverable FX options, DO)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
FX swapy bez fyzickej dodávky (non-deliverable FX swaps, NDS)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
FX swapy s fyzickou dodávkou (deliverable FX swaps, DS)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
FX futures	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Iné devízové deriváty	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR

▼B

9. **Kreditné deriváty**

▼M3

Tabuľka 9.1.

Kreditné deriváty – triedy, pre ktoré neexistuje likvidný trh

Trieda aktív – kreditné deriváty				
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**„On-the-run“ status indexu** [dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity]
Indexový swap na kreditné zlyhanie (CDS) swap, ktorého výmena peňažných tokov je spojená s úverovou bonitou niekoľkých emitentov finančných nástrojov tvoriacich index a výskytom kreditných udalostí **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	Podtrieda indexových swapov na kreditné zlyhanie je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS2#34) – podkladový index **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#42) – mena, v ktorej je uvedená pomyselná hodnota, vymedzená ako mena, v ktorej je denominovaná pomyselná hodnota derivátu **Kritérium pre segmentáciu 3** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti CDS vymedzená takto: **Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 rok** **Skupina splatností 2: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky** **Skupina splatností 3**: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … **Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	200 000 000 EUR	10	Podkladový index sa považuje za index, pre ktorý existuje likvidný trh: 1. počas celého obdobia jeho „on-the-run“ statusu 2. počas prvých 30 pracovných dní od jeho „1x off-the-run“ statusu „on-the-run“ index je rolovaná najnovšia verzia (séria) indexu vytvorená k dátumu nadobudnutia účinnosti zloženia indexu a končiaca sa jeden deň pred dátumom, ku ktorému nadobudne účinnosť ďalšia verzia (séria) indexu; „1x off-the-run status“ je verzia (séria) indexu, ktorá bezprostredne predchádza súčasnej „on-the-run“ verzii (sérii) v určitom okamihu. Verzia (séria) prestáva byť „on-the-run“ a získava svoj „1x off-the-run“ status, keď sa vytvorí najnovšia verzia (séria) indexu.

▼M3

Trieda aktív – kreditné deriváty				
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**„On-the-run“ status indexu** [dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity]
Swap na kreditné zlyhanie (CDS) zmierňujúci kreditné riziko len jednej protistrany swap, ktorého výmena peňažných tokov je spojená s úverovou bonitou jedného emitenta finančných nástrojov a výskytom kreditných udalostí **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	podtrieda swapov na kreditné zlyhanie zmierňujúcich kreditné riziko len jednej protistrany je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS2#41) – podkladový referenčný subjekt **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#39) – druh podkladového referenčného subjektu vymedzený takto: „emitent štátneho a verejného druhu“ je emitujúci subjekt, ktorým je buď: a) Únia; b) členský štát vrátane ministerstva, vládnej agentúry alebo účelovo vytvoreného subjektu členského štátu; c) štátny subjekt, ktorý nie je uvedený v písmenách a) a b); d) v prípade federatívneho členského štátu člen danej federácie; e) účelovo vytvorený subjekt pre niekoľko členských štátov; f) medzinárodná finančná inštitúcia zriadená dvoma alebo viacerými členskými štátmi, ktorej účelom je mobilizovať finančné prostriedky a poskytovať finančnú pomoc v prospech svojich členov, ktorí majú alebo ktorým hrozia vážne finančné problémy;	10 000 000 EUR	10	

▼M3

Trieda aktív – kreditné deriváty				
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**„On-the-run“ status indexu** [dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity]
	g) Európska investičná banka; h) verejný subjekt, ktorý nie je štátnym emitentom, ako je uvedené v písmenách a) až c). „Emitent korporátneho druhu“ je emitujúci subjekt, ktorý nie je emitentom štátneho a verejného druhu. **Kritérium pre segmentáciu 3** (RTS2#42) – mena, v ktorej je uvedená pomyselná hodnota, vymedzená ako mena, v ktorej je denominovaná pomyselná hodnota derivátu **Kritérium pre segmentáciu 4** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti CDS vymedzená takto: **Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 rok** **Skupina splatností 2: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky** **Skupina splatností 3**: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … **Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov			
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa toto kvalitatívne kritérium likvidity**		
Opcie na index CDS opcia, ktorej podkladovým nástrojom je index CDS	Podtrieda opcií na index CDS je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu:	opcia na index CDS, ktorej podkladovým indexom CDS je podtrieda, pre ktorú sa určilo, že pre ňu existuje likvidný trh, a ktorej skupina časov do splatnosti je 0 až 6 mesiacov, sa považuje za opciu, pre ktorú existuje likvidný trh		

▼M3

Trieda aktív – kreditné deriváty				
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**„On-the-run“ status indexu** [dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity]
RTS2#3 = DERV **RTS2#4 = CRDT**	**Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#26) – podtrieda indexu CDS, ako je stanovené pre podtriedu aktív indexového swapu na kreditné zlyhanie (CDS) **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti opcie vymedzená takto: **Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov** **Skupina splatností 2: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok** **Skupina splatností 3: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky** **Skupina splatností 4**: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … **Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov			opcia na index CDS, ktorej podkladovým indexom CDS je podtrieda, pre ktorú sa určilo, že pre ňu existuje likvidný trh, a ktorej skupina časov do splatnosti nie je 0 až 6 mesiacov, sa považuje za opciu, pre ktorú neexistuje likvidný trh opcia na index CDS, ktorej podkladovým indexom CDS je podtrieda, pre ktorú sa určilo, že pre ňu neexistuje likvidný trh, sa považuje za opciu, pre ktorú neexistuje likvidný trh, pre žiadnu skupinu časov do splatnosti
Opcie na swap na kreditné zlyhanie zmierňujúci kreditné riziko len jednej protistrany opcia, ktorej podkladovým nástrojom je swap na kreditné zlyhanie zmierňujúci kreditné riziko len jednej protistrany **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	Podtrieda opcie na swap na kreditné zlyhanie zmierňujúci kreditné riziko len jednej protistrany je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS23#26) – podtrieda swapu na kreditné zlyhanie zmierňujúceho kreditné riziko len jednej protistrany, ako je stanovené pre podtriedu aktív swapu na kreditné zlyhanie zmierňujúceho kreditné riziko len jednej protistrany			opcia na swap na kreditné zlyhanie zmierňujúci kreditné riziko len jednej protistrany, ktorej podkladovým swapom na kreditné zlyhanie zmierňujúcim kreditné riziko len jednej protistrany je podtrieda, pre ktorú sa určilo, že pre ňu existuje likvidný trh, a ktorej skupina časov do splatnosti je 0 až 6 mesiacov, sa považuje za opciu, pre ktorú existuje likvidný trh opcia na swap na kreditné zlyhanie zmierňujúci kreditné riziko len jednej protistrany, ktorej podkladovým swapom na kreditné zlyhanie zmierňujúcim kreditné riziko len jednej protistrany je podtrieda, pre ktorú sa určilo, že pre ňu existuje likvidný trh, a ktorej skupina časov do splatnosti nie je 0 až 6 mesiacov, sa považuje za opciu, pre ktorú neexistuje likvidný trh

▼M3

Trieda aktív – kreditné deriváty				
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity Pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh, sa prípadne použije dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity**		
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]	**„On-the-run“ status indexu** [dodatočné kvalitatívne kritérium likvidity]
	Kritérium pre segmentáciu 2 (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti opcie vymedzená takto: **Skupina splatností 1: 0 < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov** **Skupina splatností 2: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok** **Skupina splatností 3: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky** **Skupina splatností 4**: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … **Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov	opcia na swap na kreditné zlyhanie zmierňujúci kreditné riziko len jednej protistrany, ktorej podkladovým swapom na kreditné zlyhanie zmierňujúcim kreditné riziko len jednej protistrany je podtrieda, pre ktorú sa určilo, že pre ňu neexistuje likvidný trh, sa považuje za opciu, pre ktorú neexistuje likvidný trh, pre žiadnu skupinu časov do splatnosti		

Trieda aktív – kreditné deriváty	
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa uplatňuje nasledujúca metodika**
Iné kreditné deriváty kreditný derivát, ktorý nepatrí do žiadnej z vyššie uvedených podtried aktív **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT** RTS2#5 = OTHR	akýkoľvek iný kreditný derivát sa považuje za derivát, pre ktorý neexistuje likvidný trh

▼M4

Tabuľka 9.2.

Kreditné deriváty – predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh

Trieda aktív – kreditné deriváty									
Podtrieda aktív	**Percentily a spodné prahové hodnoty, ktoré sa majú použiť pre výpočet predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh**								
	Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt	**Predobchodná LIS**		**Poobchodná SSTI**			**Poobchodná LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**
Indexový swap na kreditné zlyhanie (CDS)	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Swap na kreditné zlyhanie zmierňujúci kreditné riziko len jednej protistrany (CDS)	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Opcie na index CDS	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – kreditné deriváty									
Podtrieda aktív	**Percentily a spodné prahové hodnoty, ktoré sa majú použiť pre výpočet predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh**								
	Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt	**Predobchodná LIS**		**Poobchodná SSTI**			**Poobchodná LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**
Opcie na swap na kreditné zlyhanie zmierňujúci kreditné riziko len jednej protistrany (CDS)	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

Tabuľka 9.3.

Kreditné deriváty – predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne neexistuje likvidný trh

Trieda aktív – kreditné deriváty			
Podtrieda aktív	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne neexistuje likvidný trh**		
	Predobchodná LIS	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Indexový swap na kreditné zlyhanie (CDS)	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Swap na kreditné zlyhanie zmierňujúci kreditné riziko len jednej protistrany (CDS)	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Opcie na index CDS	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Opcie na swap na kreditné zlyhanie zmierňujúci kreditné riziko len jednej protistrany (CDS)	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Iné kreditné deriváty	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR

▼B

10. **Deriváty C10**

▼M3

Tabuľka 10.1.

Deriváty C10 – triedy, pre ktoré neexistuje likvidný trh

Trieda aktív – deriváty C10			
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity**	
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]
Deriváty týkajúce sa dopravy Finančný nástroj týkajúci sa dopravných sadzieb v zmysle vymedzenia v oddiele C bode 10 prílohy I k smernici 2014/65/EÚ RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „FRGT“	Podtrieda derivátov týkajúcich sa dopravy je vymedzená týmito kritériami pre segmentáciu: **Kritérium pre segmentáciu 1** (RTS2#5) – druh zmluvy: futures alebo opcie **Kritérium pre segmentáciu 2** (RTS23#36) – druh dopravy **Kritérium pre segmentáciu 3** (RTS2#37) – poddruh dopravy **Kritérium pre segmentáciu 4** (RTS2#12) – špecifikácia veľkosti poddruhu dopravy **Kritérium pre segmentáciu 5** (RTS2#13) – konkrétna trasa alebo priemer časového prenájmu **Kritérium pre segmentáciu 6** (RTS2#8) – skupina časov do splatnosti derivátu vymedzená takto: **Skupina splatností 1**: 0 < čas do splatnosti ≤ 1 mesiac **Skupina splatností 2**: 1 mesiac < čas do splatnosti ≤ 3 mesiace **Skupina splatností 3**: 3 mesiace < čas do splatnosti ≤ 6 mesiacov **Skupina splatností 4**: 6 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 9 mesiacov **Skupina splatností 5**: 9 mesiacov < čas do splatnosti ≤ 1 rok **Skupina splatností 6**: 1 rok < čas do splatnosti ≤ 2 roky	10 000 000 EUR	10

▼M3

Trieda aktív – deriváty C10			
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity**	
		Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]
	Skupina splatností 7: 2 roky < čas do splatnosti ≤ 3 roky … **Skupina splatností m**: (n – 1) rokov < čas do splatnosti ≤ n rokov		

Trieda aktív – deriváty C10	
Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa uplatňuje nasledujúca metodika**
Iné deriváty C10 finančný nástroj v zmysle vymedzenia v oddiele C bode 10 prílohy I k smernici 2014/65/EÚ, ktorý nie je „derivátom týkajúcim sa dopravy“, ktorákoľvek z týchto podtried aktív úrokových derivátov: „multimenový swap na infláciu alebo krížový menový swap“, „futures/forward na multimenové swapy na infláciu alebo krížové menové swapy“, „swap na jednu menu na infláciu“, „futures/forward swap na jednu menu na infláciu“ a ktorákoľvek z týchto podtried aktív akciových derivátov: „opcia na index volatility“, „futures/forward na index volatility“, swap s parametrom výnosu z rozdielu, swap s parametrom výnosu z volatility, portfóliový swap s parametrom výnosu z rozdielu, portfóliový swap s parametrom výnosu z volatility	akýkoľvek iný derivát C10 sa považuje za derivát, pre ktorý neexistuje likvidný trh

▼M4

Tabuľka 10.2.

Deriváty C10 – predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh

Trieda aktív – deriváty C10									
Podtrieda aktív	**Percentily a spodné prahové hodnoty, ktoré sa majú použiť pre výpočet predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh**								
	Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt	**Predobchodná LIS**		**Poobchodná SSTI**			**Poobchodná LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**
Deriváty týkajúce sa dopravy	výpočet prahových hodnôt by sa mal vykonať pre každú podtriedu podtriedy aktív pri zohľadnení transakcií vykonaných vo vzťahu k finančným nástrojom patriacim do príslušnej podtriedy	70	50 000 EUR	80	60	75 000 EUR	90	70	100 000 EUR

Tabuľka 10.3.

Deriváty C10 – predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne neexistuje likvidný trh

Trieda aktív – deriváty C10			
Podtrieda aktív	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne neexistuje likvidný trh**		
	Predobchodná LIS	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Deriváty týkajúce sa dopravy	50 000 EUR	75 000 EUR	100 000 EUR
Iné deriváty C10	50 000 EUR	75 000 EUR	100 000 EUR

▼B

11. **Finančné rozdielové zmluvy (CFD)**

▼M3

Tabuľka 11.1.

CFD – triedy, pre ktoré neexistuje likvidný trh

Podtrieda aktív	**Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia**	Kvalitatívne kritérium likvidity	**Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA)** [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]
Menové CFD RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = CURR	Podtrieda menových CFD je vymedzená podkladovým menovým párom vymedzeným ako kombinácia dvoch mien tvoriacich podkladový nástroj CFD/zmluvy týkajúcej sa stávky na rozpätie. RTS2#30 a RTS2#31		50 000 000 EUR	100
Komodity CFD RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = COMM	Podtrieda komoditných CFD je vymedzená podkladovou komoditou CFD/zmluvy týkajúcej sa stávky na rozpätie RTS23#35 a RTS23#36 a RTS23#37		50 000 000 EUR	100
Akciové CFD RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = EQUI	podtrieda akciových CFD je vymedzená podkladovým kapitálovým cenným papierom CFD/zmluvy týkajúcej sa stávky na rozpätie RTS23#26	podtrieda akciových CFD sa považuje za podtriedu, pre ktorú existuje likvidný trh, ak je podkladovým nástrojom kapitálový cenný papier, pre ktorý existuje likvidný trh, ako je určené v súlade s článkom 2 ods. 1 bodom 17 písm. b) nariadenia (EÚ) č. 600/2014		
Dlhopisové CFD RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = BOND	podtrieda dlhopisových CFD je vymedzená podkladovým dlhopisom alebo futures na dlhopisy CFD/zmluvy týkajúcej sa stávky na rozpätie RTS23#26	podtrieda dlhopisových CFD sa považuje za podtriedu, pre ktorú existuje likvidný trh, ak je podkladovým nástrojom dlhopis alebo futures na dlhopis, pre ktorý existuje likvidný trh, ako je určené v súlade s článkom 6 a článkom 8 ods. 1 písm. b).		

▼M3

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa každá podtrieda aktív ďalej člení na podtriedy podľa nižšie uvedeného vymedzenia	Kvalitatívne kritérium likvidity	Priemerná denná pomyselná hodnota (ADNA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	Priemerný denný počet obchodov [kvantitatívne kritérium likvidity 2]
CFD na akciový futures/forward RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = FTEQ	podtrieda CFD na akciový futures/forward je vymedzená podkladovým futures/forwardom na akcie CFD/zmluvy týkajúcej sa stávky na rozpätie RTS23#26	podtrieda CFD na akciový futures/forward sa považuje za podtriedu, pre ktorú existuje likvidný trh, ak je podkladovým nástrojom akciový futures/forward, pre ktorý existuje likvidný trh, ako je určené v súlade s článkom 6 a článkom 8 ods. 1 písm. b).		
CFD na opciu na akcie RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OPEQ	podtrieda CFD na opciu na akcie je vymedzená podkladovou opciou na akcie CFD/zmluvy týkajúcej sa stávky na rozpätie RTS23#26	podtrieda CFD na opciu na akcie sa považuje za podtriedu, pre ktorú existuje likvidný trh, ak je podkladovým nástrojom opcia na akcie, pre ktorú existuje likvidný trh, ako je určené v súlade s článkom 6 a článkom 8 ods. 1 písm. b).		

Trieda aktív – finančné rozdielové zmluvy (CFD)

Podtrieda aktív	Na účely určenia tried finančných nástrojov, ktoré sa podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b) považujú za triedy finančných nástrojov, pre ktoré neexistuje likvidný trh, sa uplatňuje nasledujúca metodika
Iné CFD	
CFD/stávka na rozpätie, ktorá nepatrí do žiadnej z vyššie uvedených podtried aktív RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OTHR	akákoľvek iná CFD/stávka na rozpätie sa považuje za takú, pre ktorú neexistuje likvidný trh

▼M4

Tabuľka 11.2.

CFD – predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh

Trieda aktív – finančné rozdielové zmluvy (CFD)									
Podtrieda aktív	**Percentily a spodné prahové hodnoty, ktoré sa majú použiť pre výpočet predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh**								
	Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt	**Predobchodná LIS**		**Poobchodná SSTI**			**Poobchodná LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**
Menové CFD	transakcie vykonané vo vzťahu k menovým CFD považovaným za majúce likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b)	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Komoditné CFD	transakcie vykonané vo vzťahu ku komoditným CFD považovaným za majúce likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b)	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Akciové CFD	transakcie vykonané vo vzťahu k akciovým CFD považovaným za majúce likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b)	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Dlhopisové CFD	transakcie vykonané vo vzťahu k akciovým CFD považovaným za majúce likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b)	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – finančné rozdielové zmluvy (CFD)									
Podtrieda aktív	**Percentily a spodné prahové hodnoty, ktoré sa majú použiť pre výpočet predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh**								
	Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočty prahových hodnôt	**Predobchodná LIS**		**Poobchodná SSTI**			**Poobchodná LIS**		
		Obchod – percentil	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Objem – percentil**	**Spodná prahová hodnota**
CFD na akciový futures/forward	transakcie vykonané vo vzťahu k CFD na futures na akciu považovaným za majúce likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b)	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
CFD na opciu na akcie	transakcie vykonané vo vzťahu k CFD na opciu na akciu považovaným za majúce likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b)	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR

Tabuľka 11.3.

CFD – predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne neexistuje likvidný trh

Trieda aktív – finančné rozdielové zmluvy (CFD)			
Podtrieda aktív	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne neexistuje likvidný trh**		
	Predobchodná LIS	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Menové CFD	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Komoditné CFD	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

▼M4

Trieda aktív – finančné rozdielové zmluvy (CFD)			
Podtrieda aktív	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne neexistuje likvidný trh**		
	Predobchodná LIS	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Akciové CFD	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Dlhopisové CFD	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
CFD na akciový futures/forward	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
CFD na opciu na akcie	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Iné CFD/stávky na rozpätie	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

12. **Emisné kvóty**

Tabuľka 12.1.

Emisné kvóty – triedy, pre ktoré neexistuje likvidný trh

Trieda aktív – emisné kvóty	
Na účely určenia podtried aktív, pre ktoré neexistuje likvidný trh podľa článku 6a, sa uplatňuje nasledujúca metodika:	
Podtrieda aktív	**Určenie likvidity**
Emisné kvóty (EUA) každá jednotka, ktorá zodpovedá požiadavkám smernice Európskeho parlamentu a Rady 2003/87/ES ([1]) (systém obchodovania s emisiami) a predstavuje právo vypustiť ekvivalent jednej tony ekvivalentu oxidu uhličitého (tCO_2e) RTS2#3 = EMAL a RTS23#37 = EUAE	Emisné kvóty (EUA) sa považujú za kvóty, pre ktoré existuje likvidný trh
Akékoľvek iné emisné kvóty RTS2#3 = EMAL a RTS23#37 <> EUAE	Akékoľvek iné emisné kvóty sa považujú za kvóty, pre ktoré neexistuje likvidný trh

([1]) Smernica 2003/87/ES Európskeho parlamentu a Rady z 13. októbra 2003 o vytvorení systému obchodovania s emisnými kvótami skleníkových plynov v Spoločenstve, a ktorou sa mení a dopĺňa smernica Rady 96/61/ES (Ú. v. EÚ L 275, 25.10.2003, s. 32, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2003/87/oj).

▼M4

Tabuľka 12.2.

Emisné kvóty – predobchodná prahová hodnota LIS a poobchodná prahová hodnota objemu

Trieda aktív – emisné kvóty		
Podtrieda aktív	**Predobchodná LIS**	**Poobchodná prahová hodnota objemu**
Emisné kvóty (EUA)	5 000 ton ekvivalentu oxidu uhličitého	25 000 ton ekvivalentu oxidu uhličitého
Akékoľvek iné emisné kvóty	Akýkoľvek objem	Akýkoľvek objem

▼B

13. **Deriváty na emisné kvóty**

▼M3

Tabuľka 13.1.

Deriváty na emisné kvóty – triedy, pre ktoré neexistuje likvidný trh

	Trieda aktív – deriváty na emisné kvóty	
Podtrieda aktív	**Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity**	
	Priemerná denná hodnota (ADA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]
Deriváty na emisné kvóty, ktorých podkladovým nástrojom je nástroj druhu emisných kvót (EUA) finančný nástroj súvisiaci s emisnými kvótami druhu emisných kvót (EUA) v zmysle vymedzenia v oddiele C bode 4 prílohy I k smernici 2014/65/EÚ RTS2#3 = DERV a RTS2#4 = EMAL a RTS2#43 = EUAE	150 000 ton ekvivalentu oxidu uhličitého	5

▼M3

Podtrieda aktív	Trieda aktív – deriváty na emisné kvóty	
	Každá podtrieda sa určí ako podtrieda, pre ktorú neexistuje likvidný trh podľa článku 6 a článku 8 ods. 1 písm. b), ak nespĺňa jednu alebo všetky nasledujúce prahové hodnoty kvantitatívnych kritérií likvidity	
	Priemerná denná hodnota (ADA) [kvantitatívne kritérium likvidity 1]	**Priemerný denný počet obchodov** [kvantitatívne kritérium likvidity 2]
Deriváty na emisné kvóty, ktorých podkladovým nástrojom je nástroj druhu emisných kvót pre leteckú dopravu (EUAA) finančný nástroj súvisiaci s emisnými kvótami druhu emisných kvót pre leteckú dopravu (EUAA) v zmysle vymedzenia v oddiele C bode 4 prílohy I k smernici 2014/65/EÚ RTS2#3 = DERV a RTS2#4 = EMAL a RTS2#43 = EUAA	150 000 ton ekvivalentu oxidu uhličitého	5
Deriváty na emisné kvóty, ktorých podkladovým nástrojom je nástroj druhu certifikovaných znížení emisií (CER) finančný nástroj súvisiaci s emisnými kvótami druhu certifikovaných znížení emisií (CER) v zmysle vymedzenia v oddiele C bode 4 prílohy I k smernici 2014/65/EÚ RTS2#3 = DERV a RTS2#4 = EMAL a RTS2#43 = CERE	150 000 ton ekvivalentu oxidu uhličitého	5
Deriváty na emisné kvóty, ktorých podkladovým nástrojom je nástroj druhu jednotiek zníženia emisií (ERU) finančný nástroj súvisiaci s emisnými kvótami druhu jednotiek zníženia emisií (ERU) v zmysle vymedzenia v oddiele C bode 4 prílohy I k smernici 2014/65/EÚ RTS2#3 = DERV a RTS2#4 = EMAL a RTS2#43 = ERUE	150 000 ton ekvivalentu oxidu uhličitého	5
Iné deriváty na emisné kvóty derivát na emisné kvóty, ktorého podkladovým nástrojom sú emisné kvóty, ktoré zodpovedajú požiadavkám smernice 2003/87/ES (systém obchodovania s emisiami) a nie sú emisnými kvótami (EUA), emisnými kvótami pre leteckú dopravu (EUAA), certifikovanými zníženiami emisií (CER) a jednotkami zníženia emisií (ERU). RTS2#3 = DERV a RTS2#4 = EMAL a RTS2#43 = OTHR	akýkoľvek iný derivát na emisné kvóty sa považuje za derivát, pre ktorý neexistuje likvidný trh	

▼M4

Tabuľka 13.2.

Deriváty na emisné kvóty – predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh

Trieda aktív – deriváty na emisné kvóty							
Podtrieda aktív	**Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočet prahových hodnôt**	**Percentily a spodné prahové hodnoty, ktoré sa majú použiť pre výpočet predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS pre podtriedy aktív, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh**					
		Predobchodná LIS		**Poobchodná SSTI**		**Poobchodná LIS**	
		Obchod – percentil	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Spodná prahová hodnota**
Deriváty na emisné kvóty, ktorých podkladovým nástrojom je nástroj druhu emisných kvót (EUA)	transakcie vykonané vo vzťahu ku všetkým derivátom na emisné kvóty, ktorých podkladovým nástrojom je nástroj druhu emisných kvót (EUA)	70	50 000 ton oxidu uhličitého	80	90 000 ton oxidu uhličitého	90	100 000 ton oxidu uhličitého
Deriváty na emisné kvóty, ktorých podkladovým nástrojom je nástroj druhu emisných kvót pre leteckú dopravu (EUAA)	transakcie vykonané vo vzťahu ku všetkým derivátom na emisné kvóty, ktorých podkladovým nástrojom je nástroj druhu emisných kvót pre leteckú dopravu (EUAA)	70	25 000 ton oxidu uhličitého	80	40 000 ton oxidu uhličitého	90	50 000 ton oxidu uhličitého
Deriváty na emisné kvóty, ktorých podkladovým nástrojom je nástroj druhu certifikovaných znížení emisií (CER)	transakcie vykonané vo vzťahu ku všetkým derivátom na emisné kvóty, ktorých podkladovým nástrojom je nástroj druhu certifikovaných znížení emisií (CER)	70	25 000 ton oxidu uhličitého	80	40 000 ton oxidu uhličitého	90	50 000 ton oxidu uhličitého

▼M4

Trieda aktív – deriváty na emisné kvóty							
Podtrieda aktív	**Transakcie, ktoré sa majú zohľadniť pre výpočet prahových hodnôt**	**Percentily a spodné prahové hodnoty, ktoré sa majú použiť pre výpočet predobchodných a poobchodných prahových hodnôt SSTI a LIS pre podtriedy aktív, pre ktoré sa určilo, že pre ne existuje likvidný trh**					
		Predobchodná LIS		**Poobchodná SSTI**		**Poobchodná LIS**	
		Obchod – percentil	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Spodná prahová hodnota**	**Obchod – percentil**	**Spodná prahová hodnota**
Deriváty na emisné kvóty, ktorých podkladovým nástrojom je nástroj druhu jednotiek zníženia emisií (ERU)	transakcie vykonané vo vzťahu ku všetkým derivátom na emisné kvóty, ktorých podkladovým nástrojom je nástroj druhu jednotiek zníženia emisií (ERU)	70	25 000 ton oxidu uhličitého	80	40 000 ton oxidu uhličitého	90	50 000 ton oxidu uhličitého

Tabuľka 13.3.

Deriváty na emisné kvóty – predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy, pre ktoré sa určilo, že pre ne neexistuje likvidný trh

Trieda aktív – deriváty na emisné kvóty			
Podtrieda aktív	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy aktív, pre ktoré sa určilo, že pre ne neexistuje likvidný trh**		
	Predobchodná LIS	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Deriváty na emisné kvóty, ktorých podkladovým nástrojom je nástroj druhu emisných kvót (EUA)	50 000 ton oxidu uhličitého	90 000 ton oxidu uhličitého	100 000 ton oxidu uhličitého
Deriváty na emisné kvóty, ktorých podkladovým nástrojom je nástroj druhu emisných kvót pre leteckú dopravu (EUAA)	25 000 ton oxidu uhličitého	40 000 ton oxidu uhličitého	50 000 ton oxidu uhličitého

▼M4

Trieda aktív – deriváty na emisné kvóty			
Podtrieda aktív	**Predobchodné a poobchodné prahové hodnoty SSTI a LIS pre podtriedy aktív, pre ktoré sa určilo, že pre ne neexistuje likvidný trh**		
	Predobchodná LIS	**Poobchodná SSTI**	**Poobchodná LIS**
	Prahová hodnota	**Prahová hodnota**	**Prahová hodnota**
Deriváty na emisné kvóty, ktorých podkladovým nástrojom je nástroj druhu certifikovaných znížení emisií (CER)	25 000 ton oxidu uhličitého	40 000 ton oxidu uhličitého	50 000 ton oxidu uhličitého
Deriváty na emisné kvóty, ktorých podkladovým nástrojom je nástroj druhu jednotiek zníženia emisií (ERU)	25 000 ton oxidu uhličitého	40 000 ton oxidu uhličitého	50 000 ton oxidu uhličitého
Iné deriváty na emisné kvóty	25 000 ton oxidu uhličitého	40 000 ton oxidu uhličitého	50 000 ton oxidu uhličitého

▼B

PRÍLOHA IV

Referenčné údaje, ktoré sa majú poskytnúť na účely výpočtov transparentnosti

▼M3
▼C1

Tabuľka 1

Tabuľka symbolov pre tabuľku 2

SYMBOL	DRUH ÚDAJOV	VYMEDZENIE
{ALPHANUM-n}	Až n alfanumerických znakov	Pole s voľným textom.
{DECIMAL-n/m}	Desatinné číslo v rozsahu až n číslic, z toho až m číslic môžu byť zlomkové číslice	Numerické pole pre kladné aj záporné hodnoty: 1. oddeľovačom desatinných miest je „.“ (bodka); 2. pred číslom môže byť pripojený znak „–“ (mínus) na označenie záporných čísel. Hodnoty musia byť v prípade potreby zaokrúhlené, nie však skrátené.
{COUNTRYCODE_2}	2 alfanumerické znaky	dvojmiestny kód krajiny podľa normy ISO 3166-1 alfa-2
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerické znaky	trojmiestny kód meny podľa normy ISO 4217
{DATEFORMAT}	Formát dátumu podľa ISO 8601	Dátumy sa uvádzajú v tomto formáte: RRRR-MM-DD.
{ISIN}	12 alfanumerických znakov	Kód ISIN podľa normy ISO 6166
{LEI}	20 alfanumerických znakov	Identifikátor právneho subjektu podľa normy ISO 17442
{MIC}	4 alfanumerické znaky	Identifikátor trhu podľa normy ISO 10383
{EIC}	16 alfanumerických znakov	Kód EIC týkajúci sa miesta dodania v Európskej únii alebo mimo nej
{INDEX}	4 alfabetické znaky	„EONA“ – EONIA „EONS“ – EONIA SWAP „EURI“ – EURIBOR „EUUS“ – EURODOLLAR „EUCH“ – EuroSwiss „GCFR“ – GCF REPO „ISDA“ – ISDAFIX „LIBI“ – LIBID „LIBO“ – LIBOR „MAAA“ – Muni AAA „PFAN“ – Pfandbriefe „TIBO“ – TIBOR „STBO“ – STIBOR „BBSW“ – BBSW „JIBA“ – JIBAR „BUBO“ – BUBOR „CDOR“ – CDOR

▼C1

SYMBOL	DRUH ÚDAJOV	VYMEDZENIE
		„CIBO“ – CIBOR „MOSP“ – MOSPRIM „NIBO“ – NIBOR „PRBO“ – PRIBOR „TLBO“ – TELBOR „WIBO“ – WIBOR „TREA“ – Treasury „SWAP“ – SWAP „FUSW“ – Future SWAP

▼M3

Tabuľka 2

Podrobnosti referenčných údajov, ktoré sa majú poskytovať na účely výpočtov transparentnosti

#	POLE	ÚDAJE, KTORÉ SA MAJÚ OZNAMOVAŤ	FORMÁT OZNAMOVANIA
1	Identifikačný kód nástroja	Kód používaný na identifikáciu finančného nástroja	{ISIN}
2	Celý názov nástroja	Celý názov finančného nástroja	{ALPHANUM-350}
3	Identifikátor MiFIR	**Identifikácia nekapitálových finančných nástrojov:** **Sekuritizované deriváty** v zmysle vymedzenia v oddiele 4 tabuľke 4.1 prílohy III **Štruktúrované finančné produkty (SFP)** v zmysle vymedzenia v článku 2 ods. 1 bode 28 nariadenia (EÚ) č. 600/2014 **Dlhopisy (pre všetky dlhopisy s výnimkou ETC a ETN)** v zmysle vymedzenia v článku 4 ods. 1 bode 44 písm. b) smernice 2014/65/EÚ **ETC** v zmysle vymedzenia v článku 4 ods. 1 bode 44 písm. b) smernice 2014/65/EÚ a bližšie určené v oddiele 2 tabuľke 2.4 prílohy III **ETN** v zmysle vymedzenia v článku 4 ods. 1 bode 44 písm. b) smernice 2014/65/EÚ a bližšie určené v oddiele 2 tabuľke 2.4 prílohy III **Emisné kvóty** v zmysle vymedzenia v oddiele 12 tabuľke 12.1 prílohy III **Derivát** v zmysle vymedzenia v prílohe I oddiele C bodoch 4 až 10 smernice 2014/65/EÚ	**Nekapitálové finančné nástroje:** „SDRV“ – sekuritizované deriváty „SFPS“ – štruktúrované finančné produkty „BOND“ – dlhopisy „ETCS“ – ETC „ETNS“ – ETN „EMAL“ – emisné kvóty „DERV“ – derivát

▼M3

#	POLE	ÚDAJE, KTORÉ SA MAJÚ OZNAMOVAŤ	FORMÁT OZNAMOVANIA
4	Trieda aktív podkladového nástroja	Vyplní sa, keď je identifikátorom MiFIR sekuritizovaný derivát alebo derivát.	„INTR“ – úroková sadzba „EQUI“ – akcia „COMM“ – komodita „CRDT“ – kreditné „CURR“ – mena „EMAL“ – emisné kvóty „OCTN“ – iné C10
5	Druh zmluvy	Vyplní sa, keď je identifikátorom MiFIR derivát.	„OPTN“ – opcie „FUTR“ – futures [vrátane forwardových dohôd týkajúcich sa nákladnej dopravy (FFA)] „FRAS“ – dohoda o forwardovej úrokovej miere (FRA) „FORW“ – forwardy „SWAP“ – swapy „PSWP“ – portfóliové swapy „SWPT“ – swapcie „OPTS“ – opcia na swap „FONS“ – futures na swap „FWOS“ – forwardy na swap „SPDB“ – stávka na rozpätie „CFDS“ – CFD „OTHR“ – iné
6	Deň oznamovania	Deň, ku ktorému sú poskytnuté referenčné údaje	{DATEFORMAT}
7	Obchodné miesto	Segmentový MIC pre obchodné miesto, ak je k dispozícii, v opačnom prípade hlavný MIC.	{MIC}
8	Splatnosť	Stanovená splatnosť finančného nástroja. Pole sa použije pre triedy aktív dlhopisov, úrokových derivátov, akciových derivátov, komoditných derivátov, devízových derivátov, kreditných derivátov, derivátov C10 a derivátov na emisné kvóty.	{DATEFORMAT}

Polia týkajúce sa dlhopisov (všetkých druhov dlhopisov s výnimkou ETC a ETN)

Polia v tomto oddiele sa vypĺňajú len v prípade dlhopisov v zmysle vymedzenia v oddiele 2 tabuľke 2.1 prílohy III.

9	Druh dlhopisu	Druh dlhopisu v zmysle tabuľky 2.2 oddielu 2 prílohy III. Vyplní sa iba vtedy, ak identifikátor MiFIR zodpovedá dlhopisom.	„EUSB“ – štátny dlhopis „OEPB“ – iný verejný dlhopis „CVTB“ – konvertibilný dlhopis „CVDB“ – krytý dlhopis „CRPB“ – podnikový dlhopis „OTHR“ – iné

▼M3

10	Dátum emisie	Dátum, kedy je dlhopis emitovaný a začne vznikať úrok.	{DATEFORMAT}

Polia týkajúce sa emisných kvót

Polia v tomto oddiele sa vypĺňajú len v prípade emisných kvót v zmysle vymedzenia v tabuľke 12.1 oddielu 12 prílohy III.

11	Podtyp emisných kvót	Emisné kvóty	„CERE“ – CER „ERUE“ – ERU „EUAE“ – EUA „EUAA“ – EUAA „OTHR“ – iné

Polia týkajúce sa derivátov

Komoditné deriváty a deriváty C10

Polia v tomto oddiele sa vypĺňajú len v prípade komoditných derivátov v zmysle vymedzenia v tabuľke 7.1 oddielu 7 prílohy III a v prípade derivátov C10 vymedzených v tabuľke 10.1 oddielu 10 prílohy III.

12	Špecifikácia veľkosti súvisiacej s poddruhom dopravy	Toto pole sa vyplní, keď základný produkt stanovený v poli 35 v tabuľke 2 prílohy k delegovanému nariadeniu (EÚ) 2017/585 zodpovedá doprave.	V prípade dopravy po súši: „CAPE“ – Capesize „PNMX“ – Panamax „SPMX“ – Supramax „HAND“ – Handysize V prípade dopravy po vode: „CLAN“ – čisté „DRTY“ – špinavé inak {ALPHANUM-4}
13	Konkrétna trasa alebo priemer časového prenájmu	Toto pole sa vyplní, keď základný produkt stanovený v poli 35 v tabuľke 2 prílohy k delegovanému nariadeniu (EÚ) 2017/585 zodpovedá doprave.	V prípade dopravy po vode: „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

			V prípade dopravy po súši: „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 inak {ALPHANUM-6}
14	Miesto dodania/hotovostného vyrovnania	Toto pole sa vyplní, keď základný produkt stanovený v poli 35 v tabuľke 2 prílohy k delegovanému nariadeniu (EÚ) 2017/585 zodpovedá energii.	{EIC} pre elektrickú energiu alebo zemný plyn „OTHR“ – iné
15	Mena pomyselnej hodnoty	Mena, v ktorej je denominovaná pomyselná hodnota.	{CURRENCYCODE_3}

Úrokové deriváty

Polia v tomto oddiele sa vypĺňajú len v prípade úrokových derivátov v zmysle vymedzenia v tabuľke 5.1 oddielu 5 prílohy III.

16	Druh podkladového nástroja	Vyplní sa v prípade druhu zmluvy inej ako swapy, swapcie, futures na swap a forwardy na swap, a to jednou z nasledujúcich možností: ********** Vyplní sa v prípade druhov zmluvy swapy, swapcie, opcie na swap, futures na swap a forwardy na swap s ohľadom na podkladový swap, a to jednou z nasledujúcich možností:	„BOND“ – dlhopis „BNDF“ – dlhopisové futures „INTR“ – úroková sadzba „IFUT“ – úrokové futures ********** „FFMC“ – MULTIMENOVÉ SWAPY S POHYBLIVÝMI ÚROKOVÝMI SADZBAMI „XFMC“ – MULTIMENOVÉ SWAPY PEVNEJ NA POHYBLIVÚ ÚROKOVÚ SADZBU „XXMC“ – MULTIMENOVÉ SWAPY S PEVNÝMI ÚROKOVÝMI SADZBAMI „OSMC“ – JEDNODŇOVÉ INDEXOVÉ SWAPY (OIS) NA MULTIMENOVÉ SWAPY „IFMC“ – MULTIMENOVÉ SWAPY NA INFLÁCIU „FFSC“ – SWAPY NA JEDNU MENU S POHYBLIVÝMI ÚROKOVÝMI SADZBAMI „XFSC“ – SWAPY NA JEDNU MENU PEVNEJ NA POHYBLIVÚ ÚROKOVÚ SADZBU

▼M3

			„XXSC“ – SWAPY NA JEDNU MENU S PEVNÝMI ÚROKOVÝMI SADZBAMI „OSSC“ – JEDNODŇOVÉ INDEXOVÉ SWAPY (OIS) NA JEDNU MENU „IFSC“ – SWAPY NA JEDNU MENU NA INFLÁCIU
17	Emitent podkladového dlhopisu	Vyplní sa, keď je druhom podkladového nástroja dlhopis alebo dlhopisové futures s identifikačným kódom právneho subjektu (LEI) emitenta priameho alebo základného podkladového dlhopisu.	{LEI}
18	Dátum splatnosti podkladového dlhopisu	Vyplní sa stanoveným dátumom splatnosti podkladového dlhopisu.	{DATEFORMAT}
19	Dátum emisie podkladového dlhopisu	Vyplní sa dátumom emisie podkladového dlhopisu.	{DATEFORMAT}
20	Mena, v ktorej je uvedená pomyselná hodnota swapcie	Vyplní sa len pre swapcie.	{CURRENCYCODE_3}
21	Splatnosť podkladového swapu	Vyplní sa iba pre swapcie, opcie na swapy, futures na swapy a forwardy na swapy.	{DATEFORMAT}
22	Kód ISIN indexu inflácie/kód ISIN podkladového dlhopisu	V prípade swapcií týkajúcich sa jedného z týchto druhov podkladového swapu: swap na jednu menu na infláciu, futures/forwardy na swap na jednu menu na infláciu, multimenový swap na infláciu, futures/forwardy na multimenové swapy na infláciu; vždy, keď má index inflácie kód ISIN, sa musí v poli vyplniť kód ISIN daného indexu. ********** V prípade opcií na dlhopisy/opcií na opciu na dlhopisy/opcií na dlhopisové futures sa pole musí vyplniť kódom ISIN základného podkladového dlhopisu.	{ISIN} ********** {ISIN}

▼M3

23	Názov indexu inflácie	Vyplní sa štandardizovaným názvom indexu v prípade swapcií týkajúcich sa jedného z týchto druhov podkladového swapu: swap na jednu menu na infláciu, futures/forwardy na swap na jednu menu na infláciu, multimenový swap na infláciu, futures/forwardy na multimenové swapy na infláciu.	{ALPHANUM-25}
24	Referenčná sadzba	Názov referenčnej sadzby.	{INDEX} alebo {ALPHANUM-25}– ak referenčná sadzba nie je uvedená v zozname {INDEX}
25	Obdobie splatnosti podkladovej úrokovej sadzby	V tomto poli sa uvádza obdobie splatnosti podkladovej úrokovej sadzby pre zmluvu. Obdobie splatnosti sa vyjadruje v dňoch, týždňoch, mesiacoch alebo rokoch. Začína sa najdlhšou jednotkou obdobia splatnosti (roky) a pokračuje sa smerom k tým kratším; ak je obdobie splatnosti úrokovej sadzby celé číslo, v tomto poli sa uvádza takéto štandardné obdobie splatnosti.	{INTEGER-3}+„DAYS“ – dni {INTEGER-3}+„WEEK“ – týždne {INTEGER-3}+„MNTH“ – mesiace {INTEGER-3}+„YEAR“ – roky

Devízové deriváty

Polia v tomto oddiele sa vypĺňajú len v prípade devízových derivátov v zmysle vymedzenia v tabuľke 8.1 oddielu 8 prílohy III.

26	Poddruh zmluvy	Vyplní sa tak, aby sa odlíšili forwardy, opcie a swapy s fyzickou dodávkou a bez fyzickej dodávky v zmysle vymedzenia v tabuľke 8.1 oddielu 8 prílohy III.	„DLVB“ – s fyzickou dodávkou „NDLV“ – bez fyzickej dodávky

Akciové deriváty

Tieto polia sa vypĺňajú len v prípade akciových derivátov v zmysle vymedzenia v tabuľke 6.1 oddielu 6 prílohy III.

27	Druh podkladového nástroja	Vyplní sa vtedy, keď je identifikátorom MiFIR derivát, triedou aktív podkladového nástroja je akcia a podtriedou aktív nie sú ani swapy ani portfóliové swapy.	„STIX“ – akciový index „SHRS“ – akcie (share/stock) „DIVI“ – dividendový index „DVSE“ – akciová dividenda „BSKT“ – kôš akcií vyplývajúci z korporátnej udalosti „ETFS“ – ETF „VOLI“ – index volatility „OTHR“ – iné (vrátane vkladových potvrdeniek, certifikátov a iných finančných nástrojov podobných kapitálovým nástrojom)

▼M3

		********** Vyplní sa vtedy, keď je identifikátorom MiFIR derivát, triedou aktív podkladového nástroja je akcia, podtriedou aktív sú buď swapy alebo portfóliové swapy a kritériom pre segmentáciu 2 v zmysle vymedzenia v tabuľke 6.1 oddielu 6 prílohy III je jedna protistrana.	********** „SHRS“ – akcia (share/stock) „DVSE“ – akcia „ETFS“ – ETF „OTHR“ – iné (vrátane vkladových potvrdeniek, certifikátov a iných finančných nástrojov podobných kapitálovým nástrojom)
		********** Vyplní sa vtedy, keď je identifikátorom MiFIR derivát, triedou aktív podkladového nástroja je akcia, podtriedou aktív sú buď swapy alebo portfóliové swapy a kritériom pre segmentáciu 2 v zmysle vymedzenia v tabuľke 6.1 oddielu 6 prílohy III je index.	********** „STIX“ – akciový index „DIVI“ – dividendový index „VOLI“ – index volatility „OTHR“ – iné
		********** Vyplní sa vtedy, keď je identifikátorom MiFIR derivát, triedou aktív podkladového nástroja je akcia, podtriedou aktív sú buď swapy alebo portfóliové swapy a kritériom pre segmentáciu 2 v zmysle vymedzenia v tabuľke 6.1 oddielu 6 prílohy III je kôš.	********** „BSKT“ – kôš
28	Parameter	Vyplní sa vtedy, keď je identifikátorom MiFIR derivát, triedou aktív podkladového nástroja je akcia a podtriedou aktív je jedno z týchto: swapy, portfóliové swapy.	„PRBP“ – základný výkonnostný parameter výnosu z ceny „PRDV“ – parameter výnosu z dividend „PRVA“ – parameter výnosu z rozdielu „PRVO“ – parameter výnosu z volatility

Rozdielové zmluvy (CFD)

Tieto polia sa vypĺňajú iba vtedy, keď druh zmluvy zodpovedá rozdielovej zmluve alebo stávke na rozpätie.

29	Druh podkladového nástroja	Vyplní sa vtedy, keď je identifikátorom MiFIR derivát a druh zmluvy zodpovedá rozdielovej zmluve alebo stávke na rozpätie	„CURR“ – mena „EQUI“ – akcia „BOND“ – dlhopisy „FTEQ“ – futures/forward na akciu „OPEQ“ – opcie na akciu „COMM“ – komodita „EMAL“ – emisné kvóty „OTHR“ – iné

▼M3

30	Mena pomyselnej hodnoty 1	Mena 1 podkladového menového páru. Toto pole sa používa, keď je druhom podkladového nástroja mena.	{CURRENCYCODE_3}
31	Mena pomyselnej hodnoty 2	Mena 2 podkladového menového páru. Toto pole sa používa, keď je druhom podkladového nástroja mena.	{CURRENCYCODE_3}

Kreditné deriváty

Polia v tomto oddiele sa vypĺňajú len v prípade kreditných derivátov v zmysle vymedzenia v tabuľke 9.1 oddielu 9 prílohy III.

32	Kód ISIN podkladového swapu na kreditné zlyhanie	Vyplní sa kódom ISIN podkladového swapu v prípade derivátov swapov na kreditné zlyhanie.	{ISIN}
33	Kód podkladového indexu	Vyplní sa kódom ISIN indexu v prípade derivátov indexu CDS.	{ISIN}
34	Názov podkladového indexu	Vyplní sa štandardizovaným názvom indexu v prípade derivátov indexu CDS.	{ALPHANUM-25}
35	Séria	Prípadne sériové číslo zloženia indexu. Vyplní sa sériou indexu CDS v prípade indexu CDS alebo derivátu indexu CDS.	{DECIMAL-18/17}
36	Verzia	Nová verzia série sa vydá, ak jedna zo zložiek zlyhá a index sa musí znovu vážiť, aby sa zohľadnil nový počet celkových zložiek v rámci indexu. Vyplní sa verziou indexu CDS v prípade indexu CDS alebo derivátu indexu CDS.	{DECIMAL-18/17}
37	Mesiace rolovania (roll months)	Všetky mesiace, v ktorých sa očakáva rolovanie, ako stanovil poskytovateľ indexu pre daný rok. Toto pole sa zopakuje pre každý mesiac rolovania. Vyplní sa v prípade indexu CDS alebo derivátu indexu CDS.	„01“, „02“, „03“, „04“, „05“, „06“, „07“, „08“, „09“, „10“, „11“, „12“
38	Dátum ďalšieho rolovania (next roll date)	Vyplní sa ďalším dátumom rolovania indexu, ako stanovil poskytovateľ indexu, v prípade indexu CDS alebo derivátu indexu CDS.	{DATEFORMAT}
39	Emitent štátneho a verejného druhu	Vyplní sa vtedy, keď je referenčným subjektom swapu na kreditné zlyhanie zmierňujúceho kreditné riziko len jednej protistrany alebo derivátu swapu na kreditné zlyhanie zmierňujúceho kreditné riziko len jednej protistrany štátny emitent v zmysle vymedzenia v tabuľke 9.1 oddielu 9 prílohy III.	„TRUE“ – referenčný subjekt je emitent štátneho a verejného druhu „FALSE“ – referenčný subjekt nie je emitent štátneho a verejného druhu

▼M3

40	Referenčný záväzok	Vyplní sa kódom ISIN referenčného záväzku v prípade derivátu swapu na kreditné zlyhanie zmierňujúceho kreditné riziko len jednej protistrany.	{ISIN}
41	Referenčný subjekt	Vyplní sa referenčným subjektom swapu na kreditné zlyhanie zmierňujúceho kreditné riziko len jednej protistrany alebo derivátu swapu na kreditné zlyhanie zmierňujúceho kreditné riziko len jednej protistrany.	{COUNTRYCODE_2} alebo ISO 3166-2 – 2-miestny kód krajiny, po ktorom nasleduje pomlčka „-“ a kód nižšej územnej jednotky až z 3 alfanumerických znakov alebo {LEI}
42	Mena pomyselnej hodnoty	Mena, v ktorej je denominovaná pomyselná hodnota.	{CURRENCYCODE_3}

Deriváty na emisné kvóty

Polia v tomto oddiele sa vypĺňajú len v prípade derivátov na emisné kvóty v zmysle vymedzenia v tabuľke 13.1 oddielu 13 prílohy III.

43	Poddruh derivátov na emisné kvóty	Vyplní sa, ak je premenná #3 „Identifikátor MiFIR“ „DERV“ – derivát a premenná #4 „trieda aktív podkladového nástroja“ je „EMAL“ – emisná kvóta	„CERE“ – CER „ERUE“ – ERU „EUAE“ – EUA „EUAA“ – EUAA „OTHR“ – iné

▼M3

PRÍLOHA V

Kvantitatívne údaje, ktoré sa majú poskytnúť na účely výpočtov transparentnosti

Tabuľka 1

Tabuľka symbolov pre tabuľku 2

Symbol	Druh údajov	Vymedzenie
{ALPHANUM-n}	Až n alfanumerických znakov	Pole s voľným textom.
{ISIN}	12 alfanumerických znakov	Kód ISIN podľa normy ISO 6166
{MIC}	4 alfanumerické znaky	Identifikátor trhu podľa normy ISO 10383
{DATEFORMAT}	Formát dátumu podľa ISO 8601	Dátumy sa uvádzajú v tomto formáte: RRRR-MM-DD.
{DECIMAL-n/m}	Desatinné číslo v celkovom rozsahu až n číslic, z toho až m číslic môžu byť zlomkové číslice	Numerické pole pre kladné aj záporné hodnoty. Oddeľovačom desatinných miest je „.“ (bodka), pred zápornými číslami sa uvádza znamienko „–“ (mínus), hodnoty sú zaokrúhlené, nie však skrátené.
{INTEGER-n}	Celé číslo až n číslic	Numerické pole pre kladné aj záporné celočíselné hodnoty.

Tabuľka 2

Podrobnosti o údajoch, ktoré sa majú poskytovať na účely určenia likvidného trhu, prahových hodnôt LIS a SSTI pre nekapitálové finančné nástroje

#	Pole	Údaje, ktoré sa majú oznamovať	Druh miesta výkonu alebo uverejnenia	Formát a normy oznamovania
1	Identifikačný kód nástroja	Kód používaný na identifikáciu finančného nástroja	Regulovaný trh (RM) Multilaterálny obchodný systém (MTF) Organizovaný obchodný systém (OTF) Schválený mechanizmus zverejňovania (APA) Poskytovateľ konsolidovaného informačného systému (CTP)	{ISIN}
2	Dátum vykonania	Dátum vykonania obchodov.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DATEFORMAT}

▼M3

#	Pole	Údaje, ktoré sa majú oznamovať	Druh miesta výkonu alebo uverejnenia	Formát a normy oznamovania
3	Miesto vykonania	Segmentový MIC obchodného miesta EÚ alebo systematického internalizátora, ak je k dispozícii, v opačnom prípade hlavný MIC. Segmentový MIC systematického internalizátora, ak je k dispozícii, v opačnom prípade hlavný MIC. Kód MIC XOFF pre mimoburzové transakcie. Pre daný ISIN a dátum vykonania APA spočítavajú všetky mimoburzové obchodné činnosti pre daný nástroj v jednom zázname (ISIN, XOFF, dátum vykonania).	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{MIC} obchodného miesta alebo systematického internalizátora alebo „XOFF“
4	Označenie pozastaveného nástroja	Ukazovateľ toho, či bolo obchodovanie s nástrojom počas celého dňa na príslušnom obchodnom mieste v deň vykonania pozastavené. V dôsledku toho sa v poliach 5 uvádza hodnota nula.	RM, MTF, OTF	„TRUE“ – ak bol nástroj počas celého obchodného dňa pozastavený alebo „FALSE“ – ak nástroj počas celého obchodného dňa pozastavený nebol
5	Celkový počet transakcií	Celkový počet transakcií vykonaných v deň vykonania. Transakcie, ktoré boli zrušené, sa z oznamovaných údajov vylúčia. Transakcie, na ktoré sa vzťahuje odklad uverejnenia, sa do súhrnov poskytnutých predkladajúcimi subjektmi započítavajú na základe dátumu vykonania. Vo všetkých prípadoch sa v poli musí uviesť hodnota vyššia alebo rovnajúca sa nule. V prípade nástrojov, ktoré sú pozastavené na celý deň, pole musí obsahovať hodnotu nula.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
6	Celkový objem	Celkový objem vykonaný v deň vykonania. Objem sa meria v súlade s tabuľkou 4 prílohy II k tomuto nariadeniu. Peňažné sumy sa vykazujú v eurách. Transakcie, ktoré boli zrušené, sa z oznamovaných údajov vylúčia. Transakcie, na ktoré sa vzťahuje odklad uverejnenia, sa do súhrnov poskytnutých predkladajúcimi subjektmi započítavajú na základe dátumu vykonania.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

▼M3

#	Pole	Údaje, ktoré sa majú oznamovať	Druh miesta výkonu alebo uverejnenia	Formát a normy oznamovania
7	Rozsah intervalu „objem transakcie“	V tomto poli sa uvádzajú hodnoty uvedené v tabuľkách 3 a 4 tejto prílohy. Rozsah intervalu pre objem transakcie podľa vymedzenia: v tabuľke 4 tejto prílohy pre emisné kvóty a ich deriváty; v tabuľke 3 tejto prílohy pre ostatné nástroje. V prípade nástrojov, ktoré sú pozastavené na celý deň, sa údaje týkajúce sa tohto poľa a polí 8 a 9 nevykazujú.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{ALPHANUM -140}
8	Celkový počet transakcií vykonaných pre daný interval	Celkový počet transakcií vykonaných v deň vykonania, ktorých objem sa nachádza v rozsahu daného intervalu. Transakcie, ktoré boli zrušené, sa z oznamovaných údajov vylúčia. Transakcie, na ktoré sa vzťahuje odklad uverejnenia, sa do súhrnov poskytnutých predkladajúcimi subjektmi započítavajú na základe dátumu vykonania.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
9	Celkový obchodovaný objem pre daný interval	Celkový obchodovaný objem, ktorý predstavujú všetky transakcie vykonané v deň vykonania, ktorých objem sa nachádza v rozsahu daného intervalu. Objem sa meria v súlade s tabuľkou 4 prílohy II k tomuto nariadeniu. Peňažné sumy sa vykazujú v eurách. Transakcie, ktoré boli zrušené, sa z oznamovaných údajov vylúčia. Transakcie, na ktoré sa vzťahuje odklad uverejnenia, sa do súhrnov poskytnutých predkladajúcimi subjektmi započítavajú na základe dátumu vykonania.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

▼M3

Tabuľka 3

Intervaly objemu obchodov pre dlhopisy, SFP, sekuritizované deriváty, úrokové deriváty, akciové deriváty, devízové deriváty, kreditné deriváty, komoditné deriváty, deriváty C10 a CFD

Rozsah pôsobnosti	Interval „objem transakcie“	Vymedzenie
Transakcie s objemom od 0 do 1,000,000 (bez tejto sumy)	]0 – 100,000[	Transakcie s objemom obchodu menej ako 100,000 EUR
	[100,000 – 100,000]	Transakcie s objemom obchodu 100,000 EUR
	]100,000 – 200,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako 100,000 EUR a menej ako 200,000 EUR
	[200,000 – 300,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 200,000 EUR a menej ako 300,000 EUR
	[300,000 – 400,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 300,000 EUR a menej ako 400,000 EUR
	[Y – Y + 100,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným Y EUR a menej ako Y + 100,000 EUR (odstupňované po 100,000 EUR)
	[900,000 – 1,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 900,000 EUR a menej ako 1,000,000 EUR
Transakcie s objemom od 1,000,000 (vrátane) do 10,000,000 (bez tejto sumy)	[1,000,000 – 1,500,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 1,000,000 EUR a menej ako 1,500,000 EUR
	[1,500,000 – 2,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 1,500,000 EUR a menej ako 2,000,000 EUR
	[Z – Z + 500,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným Z EUR a menej ako Z + 500,000 EUR (odstupňované po 500,000 EUR)
	[9,500,000 – 10,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 9,500,000 EUR a menej ako 10,000,000 EUR
Transakcie s objemom od 10,000,000 (vrátane) do 100,000,000 (bez tejto sumy)	[10,000,000 – 15,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 10,000,000 EUR a menej ako 15,000,000 EUR
	[15,000,000 – 20,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 15,000,000 EUR a menej ako 20,000,000 EUR
	[W – W + 5,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným W EUR a menej ako W + 5,000,000 EUR (odstupňované po 5,000,000 EUR)
	[95,000,000 – 100,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 95,000,000 EUR a menej ako 100,000,000 EUR
Transakcie s objemom viac ako alebo rovným 100,000,000	[100,000,000 – 125,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 100,000,000 EUR a menej ako 125,000,000 EUR
	[125,000,000 – 150,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 125,000,000 EUR a menej ako 150,000,000 EUR
	[X – X + 25,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným X EUR a menej ako X + 25,000,000 EUR (odstupňované po 25,000,000 EUR)
…	…	…

▼M3

Tabuľka 4

Veľkosť rozsahov intervalov pre transakcie v prípade emisných kvót a derivátov na emisné kvóty

Rozsah pôsobnosti	Interval „objem transakcie“	Vymedzenie
Transakcie s objemom od 0 do 1,000,000 (bez tejto sumy)	]0 – 100,000[	Transakcie s objemom obchodu menej ako 100,000 ton ekvivalentu oxidu uhličitého (tCO_2e)
	[100,000 – 100,000]	Transakcie s objemom obchodu 100,000 tCO_2e
	]100,000 – 200,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako 100,000 tCO_2e a menej ako 200,000 tCO_2e
	[200,000 – 300,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 200,000 tCO_2e a menej ako 300,000 tCO_2e
	[300,000 – 400,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 300,000 tCO_2e a menej ako 400,000 tCO_2e
	[Y – Y + 100,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným Y tCO_2e a menej ako Y + 100,000 tCO_2e (odstupňované po 100,000 tCO_2e)
	[900,000 – 1,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 900,000 tCO_2e a menej ako 1,000,000 tCO_2e
Transakcie s objemom od 1,000,000 (vrátane) do 10,000,000 (bez tejto sumy)	[1,000,000 – 1,500,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 1,000,000 tCO_2e a menej ako 1,500,000 tCO_2e
	[1,500,000 – 2,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 1,500,000 tCO_2e a menej ako 2,000,000 tCO_2e
	[Z – Z + 500,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným Z tCO_2e a menej ako Z + 500,000 tCO_2e (odstupňované po 500,000 tCO_2e)
	[9,500,000 – 10,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 9,500,000 tCO_2e a menej ako 10,000,000 tCO_2e
Transakcie s objemom od 10,000,000 (vrátane) do 100,000,000 (bez tejto sumy)	[10,000,000 – 15,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 10,000,000 tCO_2e a menej ako 15,000,000 tCO_2e
	[15,000,000 – 20,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 15,000,000 tCO_2e a menej ako 20,000,000 tCO_2e
	[W – W + 5,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným W tCO_2e a menej ako W + 5,000,000 tCO_2e (odstupňované po 5,000,000 tCO_2e)
	[95,000,000 – 100,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 95,000,000 tCO_2e a menej ako 100,000,000 tCO_2e
Transakcie s objemom viac ako alebo rovným 100,000,000	[100,000,000 – 125,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 100,000,000 tCO_2e a menej ako 125,000,000 tCO_2e
	[125,000,000 – 150,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným 125,000,000 tCO_2e a menej ako 150,000,000 tCO_2e
	[X – X + 25,000,000[	Transakcie s objemom obchodu viac ako alebo rovným X tCO_2e a menej ako X + 25,000,000 tCO_2e (odstupňované po 25,000,000 tCO_2e)
…	…	…