To besedilo je zgolj informativne narave in nima pravnega učinka. Institucije Unije za njegovo vsebino ne prevzemajo nobene odgovornosti. Verodostojne različice zadevnih aktov, vključno z uvodnimi izjavami, so objavljene v Uradnem listu Evropske unije. Na voljo so na portalu EUR-Lex. Uradna besedila so neposredno dostopna prek povezav v tem dokumentu

►**B**

DELEGIRANA UREDBA KOMISIJE (EU) 2017/583

z dne 14. julija 2016

o dopolnitvi Uredbe (EU) št. 600/2014 Evropskega parlamenta in Sveta o trgih finančnih instrumentov v zvezi z regulativnimi tehničnimi standardi o zahtevah glede preglednosti za mesta trgovanja in investicijska podjetja v zvezi z obveznicami, strukturiranimi finančnimi produkti, pravicami do emisij in izvedenimi finančnimi instrumenti

(Besedilo velja za EGP)

(UL L 87, 31.3.2017, str. 229)

spremenjena z:

		Uradni list		
		št.	stran	datum
►**M1**	Delegirana uredba Komisije (EU) 2021/529 z dne 18. decembra 2020	L 106	47	26.3.2021
►**M2**	Delegirana uredba Komisije (EU) 2022/629 z dne 12. januarja 2022	L 115I	1	13.4.2022
►**M3**	Delegirana uredba Komisije (EU) 2023/945 z dne 17. januarja 2023	L 131	17	16.5.2023
►**M4**	Delegirana uredba Komisije (EU) 2025/1246 z dne 18. junija 2025	L 1246	1	3.11.2025

popravljena z:

►**C1** Popravek, UL L 90102, 21.11.2023, str. 1 (2023/945)

▼B

DELEGIRANA UREDBA KOMISIJE (EU) 2017/583

z dne 14. julija 2016

o dopolnitvi Uredbe (EU) št. 600/2014 Evropskega parlamenta in Sveta o trgih finančnih instrumentov v zvezi z regulativnimi tehničnimi standardi o zahtevah glede preglednosti za mesta trgovanja in investicijska podjetja v zvezi z obveznicami, strukturiranimi finančnimi produkti, pravicami do emisij in izvedenimi finančnimi instrumenti

(Besedilo velja za EGP)

POGLAVJE I

OPREDELITEV POJMOV

▼M4

Člen 1

Opredelitev pojmov

(člen 9(5), točka (f), Uredbe (EU) št. 600/2014)

V tej uredbi se uporabljajo naslednje opredelitve pojmov:

(1) „trgovalni sistem na podlagi centralne knjige naročil z omejitvami“ pomeni karkoli od naslednjega:

(a) trgovalni sistem za avtomatsko povezovanje naročil, ki s pomočjo knjige naročil in algoritma trgovanja, ki se upravlja brez človeškega posredovanja, neprekinjeno povezuje naročila za prodajo z naročili za nakup na podlagi najboljše razpoložljive cene;

(b) trgovalni sistem, ki združuje elemente trgovalnega sistema za avtomatsko povezovanje naročil, kot je naveden v točki (a), in trgovalnega sistema na podlagi rednih avkcij, kot je opredeljen v točki 2;

(2) „trgovalni sistem na podlagi rednih avkcij“ pomeni trgovalni sistem, ki povezuje naročila na podlagi rednih avkcij in algoritma trgovanja, ki se upravlja brez človeškega posredovanja.

Člen 1a

Področje uporabe členov 3, 6, 8, 9, 10, 11 in 13

1. Členi 3, 6, 9, 10, 11 in 13 se uporabljajo samo v zvezi z izvedenimi finančnimi instrumenti. Člen 8 se uporablja samo za izvedene finančne instrumente in paketne posle.

2. Sklicevanja na člen 11 Uredbe (EU) št. 600/2014 v členih 8 in 11 te uredbe se štejejo za sklicevanja na člen 11 Uredbe (EU) št. 600/2014, kot se je uporabljala pred 28. marcem 2024.

▼B

POGLAVJE II

PREGLEDNOST PRED POSLOVANJEM ZA REGULIRANE TRGE, VEČSTRANSKE SISTEME TRGOVANJA IN ORGANIZIRANE SISTEME TRGOVANJA

Člen 2

Obveznosti glede preglednosti pred trgovanjem

(člen 8(1) in (2) Uredbe (EU) št. 600/2014)

Upravljavci trga in investicijska podjetja, ki upravljajo mesto trgovanja, objavijo razpon ponujenih nakupnih in prodajnih cen in globino trgovskih interesov pri navedenih cenah, v skladu z vrsto trgovalnega sistema, ki ga upravljajo, in zahtevami po informacijah iz Priloge I.

Člen 3

Velika naročila

(člen 9(1)(a) Uredbe (EU) št. 600/2014)

Naročilo je veliko v primerjavi z običajnim tržnim obsegom, kadar je ob vnosu ali po vsaki spremembi naročila enako ali večje kot najmanjši obseg naročila, ki se določi v skladu z metodologijo iz člena 13.

▼M4

Člen 3a

Velika naročila za obveznice, strukturirane finančne produkte in pravice do emisije

(člen 9(1), točka (a), Uredbe (EU) št. 600/2014)

Naročilo za obveznice, strukturirane finančne produkte ali pravice do emisije je v primerjavi z običajnim tržnim obsegom veliko, kadar je ob vnosu ali vsaki spremembi enako ali večje od naslednjih pragov:

(a) za vse vrste obveznic razen za blago, s katerim se trguje na borzi (v nadaljnjem besedilu: ETC), in zapisov, s katerimi se trguje na borzi (v nadaljnjem besedilu: ETN), pragov iz tabele 2.3 Priloge III;

(b) za ETC in ETN pragov iz tabele 2.5 Priloge III;

(c) za strukturirane finančne produkte pragov iz tabele 3.2 Priloge III;

(d) za pravice do emisije pragov iz tabele 12.2 Priloge III.

▼B

Člen 4

Vrsta in najmanjši obseg naročil, ki so v sistemu za upravljanje naročil

(člen 9(1)(a) Uredbe (EU) št. 600/2014)

1. Vrsta naročila, ki je v sistemu za upravljanje naročil mesta trgovanja do svojega razkritja, za katerega se lahko opustijo obveznosti glede preglednosti pred trgovanjem, je naročilo, ki:

(a) bo razkrito v knjigi naročil, ki jo vodi mesto trgovanja, in je odvisno od objektivnih pogojev, ki so predhodno opredeljeni v protokolu sistema;

(b) ne sovpliva na druge trgovske interese pred razkritjem v knjigi naročil, ki jo vodi mesto trgovanja;

(c) po razkritju v knjigi naročil sovpliva na druga naročila v skladu s pravili, ki se ob razkritju uporabljajo za naročila navedene vrste.

2. Najmanjši obseg naročil, ki so v sistemu za upravljanje naročil mesta trgovanja do svojega razkritja, za katera se lahko opustijo obveznosti glede preglednosti pred trgovanjem, je ob vnosu in po vsaki spremembi naslednji:

(a) pri naročilu s skrito količino znaša 10 000 EUR ali več;

(b) pri vseh drugih naročilih je obseg enak najmanjši količini, s katero se lahko trguje, ki jo vnaprej določi upravljavec sistema v skladu s svojimi pravili in protokoli.

3. Naročilo s skrito količino (*reserve order*) iz odstavka 2(a) se šteje za limitirano naročilo, ki ga sestavljata razkrito naročilo, ki se nanaša na del količine, in nerazkrito naročilo, ki se nanaša na preostalo količino, pri čemer se nerazkrita količina lahko izvrši šele po vnosu v knjigo naročil kot novo razkrito naročilo.

▼M3

4. Za namene odstavka 2, točka (a), se obseg naročil v sistemu za upravljanje naročil meri z nominalnim zneskom trgovanih pogodb, kot je navedeno v Prilogi II, tabela 2, polje 10.

▼M4

———————

▼B

Člen 6

Razredi finančnih instrumentov, za katere likviden trg ne obstaja

(člen 9(1)(c) Uredbe (EU) št. 600/2014)

Za finančni instrument ali razred finančnih instrumentov se šteje, da nima likvidnega trga, če je tako določeno v skladu z metodologijo iz člena 13.

▼M4

Člen 6a

Razredi obveznic, strukturiranih finančnih produktov in pravic do emisije, za katere likviden trg ne obstaja

(člen 9(1), točka (c), Uredbe (EU) št. 600/2014)

Pristojni organi za določitev, ali se za obveznico, strukturirani finančni produkt ali pravico do emisije šteje, da zanje ne obstaja likviden trg, uporabijo naslednjo statično določanje likvidnosti:

(a) za vse vrste obveznic razen ETC in ETN določitev iz tabele 2.2 Priloge III;

(b) za ETC in ETN določitev iz tabele 2.4 Priloge III;

(c) za strukturirane finančne produkte določitev iz tabele 3.1 Priloge III;

(d) za pravice do emisije določitev iz tabele 12.1 Priloge III.

▼B

POGLAVJE III

PREGLEDNOST PO TRGOVANJU ZA MESTA TRGOVANJA IN INVESTICIJSKA PODJETJA, KI TRGUJEJO ZUNAJ MESTA TRGOVANJA

Člen 7

Obveznosti glede preglednosti po trgovanju

(člen 10(1) ter člen 21(1) in (5) Uredbe (EU) št. 600/2014)

1. Investicijska podjetja, ki trgujejo zunaj pravil mesta trgovanja, ter upravljavci trga in investicijska podjetja, ki upravljajo mesto trgovanja, s sklicem na vsak posel objavijo podatke iz tabel 1 in 2 Priloge II in uporabijo posamezne relevantne oznake iz tabele 3 Priloge II.

▼M4

Imena polj iz tabele 2 Priloge II se objavijo z uporabo enakih dogovorov o poimenovanju, kot so določeni v identifikatorju polja v navedeni tabeli.

▼B

2. Če se predhodno objavljeno poročilo o trgovanju prekliče, investicijska podjetja, ki trgujejo zunaj mesta trgovanja, ter upravljavci trga in investicijska podjetja, ki upravljajo mesto trgovanja, objavijo novo poročilo o trgovanju, ki vsebuje vse podatke iz izvirnega poročila o trgovanju in oznako o preklicu iz tabele 3 Priloge II.

3. Če se predhodno objavljeno poročilo o trgovanju spremeni, investicijska podjetja, ki trgujejo zunaj mesta trgovanja, ter upravljavci trga in investicijska podjetja, ki upravljajo mesto trgovanja, objavijo naslednje informacije:

(a) novo poročilo o trgovanju, ki vsebuje vse podatke izvirnega poročila o trgovanju in oznako o preklicu iz tabele 3 Priloge II;

(b) novo poročilo o trgovanju, ki vsebuje vse podrobnosti izvirnega poročila o trgovanju z vsemi potrebnimi popravljenimi podatki in oznako o spremembi iz tabele 3 Priloge II.

▼M4

4. Informacije po trgovanju se objavijo kar se da blizu realnemu času, kot je tehnično izvedljivo in v vsakem primeru v petih minutah po izvršitvi zadevnega posla.

_____

▼B

7. Investicijski podjetji sprejmeta vse razumne ukrepe, da zagotovita, da se posel objavi kot en posel. Zato se ujemajoča se posla, evidentirana ob istem času in po isti ceni, ki vključujeta eno stranko, štejeta za en posel.

▼M4

8. Informacije o paketnem poslu vključujejo oznako paketnega posla ali oznako zamenjave za fizična sredstva iz tabele 3 Priloge II. Kadar je paketni posel primeren za odlog objave v skladu s členom 8, se informacije o vseh sestavinah dajo na voljo po poteku obdobja odloga za posel.

▼B

Člen 8

Odlog objave poslov

(člen 11(1) in (3) ter člen 21(4) Uredbe (EU) št. 600/2014)

1. Kadar pristojni organ odobri odlog objave za podatke o poslu v skladu s členom 11(1) Uredbe (EU) št. 600/2014, investicijska podjetja, ki trgujejo zunaj mesta trgovanja, in upravljavci trga in investicijska podjetja, ki upravljajo mesto trgovanja, objavijo vsak posel najpozneje do 19:00 po lokalnem času na drugi delovni dan po datumu posla pod pogojem, da je izpolnjen eden od naslednjih pogojev:

(a) posel je velik v primerjavi z običajnim tržnim obsegom, kot je določen v členu 9;

▼B

(b) gre za posel s finančnim instrumentom ali razredom finančnih instrumentov, za katere se šteje, da zanje likviden trg ne obstaja, kot je določeno v skladu z metodologijo iz člena 13;

(c) posel se izvrši med investicijskim podjetjem, ki posluje za svoj račun, vendar ne v obliki trgovanja s hkratnim nakupom in prodajo, kot je določeno v členu 4(1)(38) Direktive 2014/65/EU Evropskega parlamenta in Sveta ([1]), in drugo nasprotno stranko, in je večji od obsega, značilnega za finančni instrument, kot je določeno v členu 10;

(d) posel je paketni posel, ki izpolnjuje enega od naslednjih meril:

(i) ena ali več njegovih sestavin so posli s finančnimi instrumenti, ki nimajo likvidnega trga;

(ii) ena ali več njegovih sestavin so posli s finančnimi instrumenti, ki so veliki v primerjavi z običajnim tržnim obsegom, kot je določen v členu 9;

(iii) posel se izvrši med investicijskim podjetjem, ki posluje za svoj račun, vendar ne v obliki trgovanja s hkratnim nakupom in prodajo, kot je določeno v členu 4(1)(38) Direktive 2014/65/EU, in drugo nasprotno stranko, in ena ali več njegovih sestavin so posli s finančnimi instrumenti, ki so večji od obsega, značilnega za finančni instrument, kot je določen v členu 10.

2. Ko rok odloga iz odstavka 1 poteče, se objavijo vsi podatki o poslu, razen kadar se odobri podaljšano obdobje odloga ali odlog za nedoločen čas v skladu s členom 11.

3. Če se posel med dvema investicijskima podjetjema za njun račun ali v imenu strank izvrši zunaj pravil mesta trgovanja, je zadevni pristojni organ za namen določitve veljavne ureditve odloga pristojni organ investicijskega podjetja, ki je odgovorno za objavo posla prek APA v skladu z odstavki 5, 6 in 7 člena 7.

▼M4

Člen 8a

Odlog objave poslov za obveznice, strukturirane finančne produkte in pravice do emisije

(člen 11 Uredbe (EU) št. 600/2014)

1. Upravljavci trga in investicijska podjetja, ki upravljajo mesto trgovanja, ter investicijska podjetja, ki trgujejo zunaj mesta trgovanja, lahko odložijo objavo podrobnosti o poslih v zvezi z obveznicami, razen ETC in ETN, v skladu z naslednjim:

([1]) Direktiva 2014/65/EU Evropskega parlamenta in Sveta z dne 15. maja 2014 o trgih finančnih instrumentov ter spremembi Direktive 2002/92/ES in Direktive 2011/61/EU (UL L 173, 12.6.2014, str. 349).

▼M4

(a) odložitev cene in odložitev obsega, ki ne presegata 15 minut, za posle iz kategorije 1 iz tabele 2.6 Priloge III;

(b) odložitev cene in odložitev obsega, ki ne presegata konca trgovalnega dne, za posle iz kategorije 2 iz tabele 2.6 Priloge III;

(c) odložitev cene, ki ne presega konca prvega trgovalnega dne po datumu posla, in odložitev obsega, ki ne presega enega tedna po datumu posla, za posle iz kategorije 3 iz tabele 2.6 Priloge III;

(d) odložitev cene, ki ne presega konca drugega trgovalnega dne po datumu posla, in odložitev obsega, ki ne presega dveh tednov po datumu posla, za posle iz kategorije 4 iz tabele 2.6 Priloge III;

(e) odložitev cene in odložitev obsega, ki ne presegata štirih tednov po datumu posla, za posle iz kategorije 5 iz tabele 2.6 Priloge III.

2. Upravljavci trga in investicijska podjetja, ki upravljajo mesto trgovanja, ter investicijska podjetja, ki trgujejo zunaj mesta trgovanja, lahko odložijo objavo podrobnosti o poslih v zvezi z ETC, ETN in strukturiranimi finančnimi produkti v skladu z naslednjim:

(a) odložitev cene, ki ne presega konca drugega trgovalnega dne po datumu posla, za posle vseh obsegov in

(b) odložitev obsega, ki ne presega dveh tednov po datumu posla, za posle vseh obsegov.

3. Upravljavci trga in investicijska podjetja, ki upravljajo mesto trgovanja, ter investicijska podjetja, ki trgujejo zunaj mesta trgovanja, vsak posel v zvezi s pravicami do emisije objavijo najpozneje do 19.00 po lokalnem času na drugi delovni dan po datumu posla, pod pogojem, da posel presega odlog objave po trgovanju za pravice do emisije iz tabele 12.2 Priloge III.

▼B

Člen 9

Veliki posli

(člen 11(1)(a) Uredbe (EU) št. 600/2014)

Posel se šteje za velikega v primerjavi z običajnim tržnim obsegom, kadar je enak ali večji od najmanjšega obsega posla, ki se izračuna v skladu z metodologijo iz člena 13.

▼B

Člen 10

Obseg, značilen za finančni instrument

(člen 11(1)(c) Uredbe (EU) št. 600/2014)

Posel se šteje za večjega od obsega, značilnega za finančni instrument, kadar je enak ali večji od najmanjšega obsega posla, ki se izračuna v skladu z metodologijo iz člena 13.

Člen 11

Zahteve o preglednosti skupaj z odlogom objave po presoji pristojnih organov

(člen 11(3) Uredbe (EU) št. 600/2014)

1. Kadar pristojni organi izvajajo svoja pooblastila skupaj s pooblastilom za odlog objave v skladu s členom 11(3) Uredbe (EU) št. 600/2014, velja naslednje:

(a) kadar se uporablja člen 11(3)(a) Uredbe (EU) št. 600/2014, pristojni organi zahtevajo, da se v celotnem obdobju odloga, kot je določeno v členu 8, objavi ena od naslednjih informacij:

(i) vsi podatki o poslu, določeni v tabelah 1 in 2 Priloge II, razen podatkov o obsegu;

(ii) posli v dnevno agregatni obliki za vsaj 5 poslov, izvršenih na isti dan, se objavijo na naslednji delovni dan pred 9:00 po lokalnem času;

(b) kadar se uporablja člen 11(3)(b) Uredbe (EU) št. 600/2014, pristojni organi dovolijo opustitev objave obsega posameznega posla v času podaljšanega trajanja odloga, ki traja štiri tedne;

(c) v zvezi z nelastniškimi instrumenti, ki niso državni vrednostni papirji, in kadar se uporablja člen 11(3)(c) Uredbe (EU) št. 600/2014, pristojni organi v času podaljšanega trajanja odloga za obdobje, ki traja štiri tedne, dovolijo objavo več poslov, izvršenih v enem koledarskem tednu, v agregatni obliki, in sicer naslednji torek pred 9:00 po lokalnem času.

▼M4

_____

▼B

2. Ko podaljšano obdobje odloga iz odstavka 1(b) poteče, veljajo naslednje zahteve:

(a) za vse instrumente, ki niso državni vrednostni papirji se vsi podatki o posameznih poslih objavijo naslednji delovni dan pred 9:00 po lokalnem času.

▼M4

_____

▼B

3. Za vse instrumente, ki niso državni vrednostni papirji, se vsi podatki o posameznih poslih objavijo štiri tedne po objavi združenih podatkov v skladu s členom 1(c) pred 9:00 po lokalnem času.

▼M4

4. Agregirani dnevni ali tedenski podatki iz odstavkov 1 in 2 vsebujejo naslednje informacije o izvedenih finančnih instrumentih za vsak dan ali teden zadevnega koledarskega obdobja:

(a) tehtano povprečno ceno;

(b) skupni obseg trgovanja iz tabele 4 Priloge II;

(c) skupno število poslov.

▼B

5. Posli se združujejo glede na kodo ISIN. Če koda ISIN ni na voljo, se posli združijo na ravni razreda finančnih instrumentov, za katere se uporablja preskus likvidnosti iz člena 13.

▼M4

6. Kadar dan v tednu za objavo iz odstavka 1, točka (c), ter odstavkov 2 in 3 ni delovni dan, se objava izvede naslednji delovni dan pred 9.00 po lokalnem času.

Člen 11a

Zahteve o preglednosti za državne dolžniške instrumente skupaj z odlogom objave po presoji pristojnih organov

(člen 11(3) Uredbe (EU) št. 600/2014)

1. Objava podrobnosti več poslov v agregirani obliki iz člena 11(3), točka (b), Uredbe (EU) št. 600/2014 zajema posle, ki so bili izvršeni v enem koledarskem tednu, in se izvede naslednji torek pred 9.00 po lokalnem času.

2. Agregirani tedenski podatki iz odstavka 1 vsebujejo naslednje informacije za vsak teden zadevnega koledarskega obdobja:

(a) tehtano povprečno ceno;

(b) skupni obseg trgovanja iz tabele 4 Priloge II;

(c) skupno število poslov.

3. Posli se združujejo glede na kodo ISIN.

4. Kadar dan v tednu za objavo iz odstavka 1 ni delovni dan, se objava izvede naslednji delovni dan pred 9.00 po lokalnem času.

▼M3

Člen 12

Uporaba preglednosti po trgovanju za nekatere vrste poslov, izvršene zunaj mesta trgovanja

(člen 21(1) Uredbe (EU) št. 600/2014)

Obveznosti iz člena 21(1) Uredbe (EU) št. 600/2014 se ne uporabljajo za posle, navedene v členu 2(5) Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/590 ([1]).

▼B

POGLAVJE IV

SKUPNE DOLOČBE ZA PREGLEDNOST PRED TRGOVANJEM IN PO NJEM

Člen 13

Metodologija za izvedbo izračunov za preglednost

(člen 9(1) in (2), člen 11(1) ter člen 22(1) Uredbe (EU) št. 600/2014)

1. Za določitev finančnih instrumentov ali razredov finančnih instrumentov, za katere likviden trg ne obstaja, za namene člena 6 in točke (b) odstavka 1 člena 8, se uporabijo naslednje metodologije za razrede sredstev:

(a) Statično določanje likvidnosti za:

(i) razred sredstev „listinjeni izvedeni finančni instrumenti“, kot so opredeljeni v tabeli 4.1 Priloge III;

(ii) naslednje podrazrede sredstev lastniških izvedenih finančnih instrumentov: „opcije na delniške indekse“, „standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na delniške indekse“, „delniške opcije“, „standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na delnice“, „opcije na dividende iz delnic“, „standardizirane/nestandardizirane pogodbe na dividende iz delnic“, „opcije na indekse dividend“, „standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na indekse dividend“, „opcije na indekse volatilnosti“, „standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na indekse volatilnosti“, „opcije na investicijske sklade, s katerimi se trguje na borzi“, „standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na investicijske sklade, s katerimi se trguje na borzi“, in „drugi lastniški izvedeni instrumenti“, kot so opredeljeni v tabeli 6.1 Priloge III;

(iii) razred sredstev „valutni izvedeni finančni instrumenti“, kot so opredeljeni v tabeli 8.1 Priloge III;

▼M4

(iv) podrazrede sredstev „drugi obrestni finančni instrumenti“, „drugi izvedeni finančni instrumenti na blago“, „drugi kreditni izvedeni finančni instrumenti“, „drugi izvedeni finančni instrumenti C10“, „druge pogodbe na razliko“ in „drugi izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije“ iz tabel 5.1, 7.1, 9.1, 10.1, 11.1 in 13.1 Priloge III.

([1]) Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/590 z dne 28. julija 2016 o dopolnitvi Uredbe (EU) št. 600/2014 Evropskega parlamenta in Sveta v zvezi z regulativnimi tehničnimi standardi o poročanju o poslih pristojnim organom, C/2016/4733 (UL L 87, 31.3.2017, str. 449).

▼B

(b) Redna ocena na podlagi kvantitativnih in, kjer je ustrezno, kvalitativnih meril za likvidnost za:

▼M4

_____

▼B

(iii) razred sredstev „obrestni izvedeni finančni instrumenti“, razen podrazreda sredstev „drugi obrestni izvedeni instrumenti“, kot so opredeljeni v tabeli 5.1 Priloge III;

(iv) naslednje podrazrede sredstev lastniških izvedenih finančnih instrumentov: „zamenjave“ in „portfeljske zamenjave“, kot so opredeljene v tabeli 6.1 Priloge III;

(v) razred sredstev „izvedeni finančni instrumenti na blago“, razen podrazreda sredstev „drugi izvedeni finančni instrumenti na blago“, kot so opredeljeni v tabeli 7.1 Priloge III;

(vi) naslednje podrazrede sredstev kreditnih izvedenih finančnih instrumentov: „indeksi kreditnih zamenjav“ in „kreditne izmenjave za eno samo izpostavljenost“, kot so opredeljeni v tabeli 9.1 Priloge III;

(vii) razred sredstev „izvedeni finančni instrumenti C10“, razen podrazreda sredstev „drugi izvedeni finančni instrumenti C10“, kot so opredeljeni v tabeli 10.1 Priloge III;

(viii) naslednje podrazrede sredstev pogodb na razliko: „valutne finančne pogodbe na razliko“ in „blagovne finančne pogodbe na razliko“, kot so opredeljene v tabeli 11.1 Priloge III;

▼M4

_____

▼B

(x) razred sredstev „izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije“, razen podrazreda sredstev „drugi izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije“, kot so opredeljeni v tabeli 13.1 Priloge III.

(c) Redna ocena na podlagi kvalitativnih meril likvidnosti za:

(i) naslednje podrazrede sredstev kreditnih izvedenih finančnih instrumentov: „opcije na indeks kreditnih zamenjav“ in „opcije na kreditne zamenjave z eno samo izpostavljenostjo“, kot so opredeljene v tabeli 9.1 Priloge III;

(ii) naslednje podrazrede sredstev pogodb na razliko: „finančne pogodbe na razliko za lastniške vrednostne papirje“, „finančne pogodbe na razliko za obveznice“, „finančne pogodbe na razliko za standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na lastniške vrednostne papirje“ in „finančne pogodbe na razliko za opcije na lastniške vrednostne papirje“, kot so opredeljene v tabeli 11.1 Priloge III.

▼M4

_____

▼B

2. ►M4 Za določanje naročil, ki so velika v primerjavi z običajnim tržnim obsegom, kot so navedena v členu 3, se uporabijo naslednje metodologije: ◄

(a) vrednost praga za:

▼M4

_____

▼B

(ii) razred sredstev „listinjeni izvedeni finančni instrumenti“, kot so opredeljeni v tabeli 4.2 Priloge III;

(iii) vse podrazrede lastniških izvedenih finančnih instrumentov, kot so opredeljeni v tabeli 6.2 in 6.3 Priloge III;

(iv) vse podrazrede valutnih izvedenih finančnih instrumentov, kot so opredeljeni v tabeli 8.2 Priloge III;

(v) vse podrazrede, za katere se šteje, da nimajo likvidnega trga, za razrede sredstev „obrestni izvedeni finančni instrumenti“, „izvedeni finančni instrumenti na blago“, „kreditni izvedeni finančni instrumenti“, „izvedeni finančni instrumenti C10“ in „pogodbe za razliko“, kot so opredeljeni v tabelah 5.3, 7.3, 9.3, 10.3 in 11.3 Priloge III;

▼M4

(vi) vse podrazrede sredstev, za katere se šteje, da nimajo likvidnega trga, za razrede sredstev „izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije“ iz tabele 13.3 Priloge III.

_____

▼B

(b) ►M4 velikost posla, pod katero se nahaja odstotek poslov, ki ustrezajo percentilu poslov, ali spodnji prag, odvisno od tega, katera vrednost je višja, za: ◄

▼M4

_____

▼B

(ii) vse podrazrede, ki imajo likviden trg, za razrede sredstev „obrestni izvedeni finančni instrumenti“, „izvedeni finančni instrumenti na blago“, „kreditni izvedeni finančni instrumenti“, „izvedeni finančni instrumenti C10“ in „pogodbe za razliko“, kot so opredeljeni v tabelah 5.2, 7.2, 9.2, 10.2 in 11.2 Priloge III;

▼M4

(iii) vse podrazrede sredstev, ki imajo likviden trg, za razred sredstev „izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije“ iz tabele 13.2 Priloge III;

_____

▼B

3. Za določitev obsega, značilnega za finančni instrument, iz člena 8(1)(c) in poslov, ki so veliki v primerjavi z običajnim tržnim obsegom, iz člena 8(1)(a) se uporabijo naslednje metodologije:

(a) vrednost praga za:

▼M4

_____

▼B

(ii) razred sredstev „listinjeni izvedeni finančni instrumenti“, kot so opredeljeni v tabeli 4.2 Priloge III;

(iii) vse podrazrede lastniških izvedenih finančnih instrumentov, kot so opredeljeni v tabeli 6.2 in 6.3 Priloge III;

(iv) vse podrazrede valutnih izvedenih finančnih instrumentov, kot so opredeljeni v tabeli 8.2 Priloge III;

(v) vse podrazrede, za katere se šteje, da nimajo likvidnega trga, za razrede sredstev „obrestni izvedeni finančni instrumenti“, „izvedeni finančni instrumenti na blago“, „kreditni izvedeni finančni instrumenti“, „izvedeni finančni instrumenti C10“ in „pogodbe za razliko“, kot so opredeljeni v tabelah 5.3, 7.3, 9.3, 10.3 in 11.3 Priloge III;

▼M4

(vi) vse podrazrede sredstev, za katere se šteje, da nimajo likvidnega trga, za razred sredstev „izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije“ iz tabele 13.3 Priloge III;

_____

_____

▼B

(c) velikost poslov, pod katero se nahaja odstotek poslov, ki ustrezajo percentilu poslov, velikost poslov, pod katero se nahaja odstotek obsega, ki ustreza percentilu obsega, ali spodnji prag za vsako podkategorijo, za katero se šteje, da ima likviden trg, odvisno od tega, katera vrednost je višja, za razrede sredstev „obrestni izvedeni finančni instrumenti“, „izvedeni finančni instrumenti na blago“, „kreditni izvedeni finančni instrumenti“, „izvedeni finančni instrumenti C10“ in „finančne pogodbe na razliko“, kot je določeno v tabelah 5.2, 7.2, 9.2, 10.2 in 11.2 Priloge III;

▼M4

(d) velikost posla, pod katero se nahaja odstotek poslov, ki ustrezajo percentilu poslov, ali spodnji prag, odvisno od tega, katera vrednost je višja, za vse podrazrede sredstev, za katere se šteje, da imajo likviden trg, za razred sredstev „izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije“ iz tabele 13.2 Priloge III.

▼B

4. Za namene odstavka 3(c) se obseg trgovanja ne upošteva, kadar je velikost posla, ki ustreza percentilu obsega za določitev poslov, ki so veliki v primerjavi z običajnim tržnim obsegom, višja od 97,5 percentila poslov; obseg, značilen za finančni instrument, iz člena 8(1)(c) in velikost poslov, ki so veliki v primerjavi z običajnim tržnim obsegom, iz člena 8(1)(a) pa se določita kot velikost posla, pod katero se nahaja odstotek poslov, ki ustrezajo percentilu poslov, ali spodnji prag, odvisno od tega, katera vrednost je višja.

▼B

5. V skladu z delegiranima uredbama (EU) 2017/590 in (EU) 2017/577 pristojni organi od mest trgovanja, APA in CTP dnevno zbirajo podatke, ki so potrebni za izvedbo izračunov za določitev:

(a) finančnih instrumentov in razredov finančnih instrumentov, ki nimajo likvidnega trga, kot je določeno v odstavku 1;

▼M4

(b) velikosti, ki so velike v primerjavi z običajnim tržnim obsegom, in obsega, značilnega za finančni instrument, kot je določeno v odstavku 3.

▼M3

Podatki iz prvega pododstavka se zbirajo v skladu s Prilogo V.

▼B

6. Pristojni organi, ki opravijo izračune za razred finančnih instrumentov, vzpostavijo medsebojne dogovore o sodelovanju, da zagotovijo združevanje podatkov, ki so potrebni za izračune, po vsej Uniji.

▼M4

7. Za namene odstavka 1, točka (b), odstavka 2, točka (b) in odstavka 3, točki (c) in (d), pristojni organi upoštevajo posle, izvršene v Uniji med 1. januarjem in 31. decembrom predhodnega leta.

8. Velikost posla za namene odstavka 2, točka (b), in odstavka 3, točki (c) in (d), se določi na podlagi mer obsega, kot so določene v tabeli 4 Priloge II. Kadar je velikost posla, določena za namene odstavkov 2 in 3, izražena z denarno vrednostjo in finančni instrument ni denominiran v eurih, se velikost posla spremeni v valuto, v kateri je navedeni finančni instrument denominiran, pri čemer se uporabi referenčni menjalni tečaj eura Evropske centralne banke na dan 31. decembra predhodnega leta.

▼B

9. Upravljavci trga in investicijska podjetja, ki upravljajo mesto trgovanja, lahko pretvorijo velikosti poslov, določene v skladu z odstavki 2 in 3, v ustrezno število enot, kot je vnaprej določilo navedeno mesto trgovanja za posamezne podkategorije ali podrazrede sredstev. Upravljavci trga in investicijska podjetja, ki upravljajo mesto trgovanja, vzdržujejo takšne velikosti poslov do uporabe rezultatov naslednjih izračunov, opravljenih v skladu z odstavkom 17.

▼M4

_____

11. Za namene denominacij iz odstavkov 2 in 3 se odstavek 2, točka (b), in odstavek 3, točki (c) in (d), ne uporabljata, kadar je število poslov, ki se upoštevajo v izračunu, manjše od 1 000. V takih primerih se uporabljajo vrednosti pragov, določene v odstavku 2, točka (a), in odstavku 3, točka (a).

▼B

12. ►M4 Razen kadar se nanašajo na izvedene finančne instrumente na pravice do emisije, se izračuni iz odstavka 2, točka (b), in odstavka 3, točka (c), zaokrožijo na najbližjih: ◄

(a) 100 000, kadar je vrednost praga nižja od 1 milijona;

(b) 500 000, kadar je vrednost praga enaka ali višja od 1 milijona, a nižja od 10 milijonov;

(c) 5 milijonov, kadar je vrednost praga enaka ali višja od 10 milijonov, a nižja od 100 milijonov;

(d) 25 milijonov, kadar je vrednost praga enaka ali višja od 100 milijonov.

13. Za namene odstavka 1 se kvantitativna merila likvidnosti, določena za vsak razred sredstev v Prilogi III, določijo v skladu z oddelkom 1 Priloge III.

▼M4

14. Za lastniške izvedene finančne instrumente, ki so uvrščeni v trgovanje ali s katerimi se je prvič trgovalo na mestu trgovanja, ki ne spadajo v podkategorijo, za katero so se objavili obseg, značilen za finančni instrument, iz člena 8(1)(c) ter velikost naročil in obseg poslov, ki so veliki v primerjavi z običajnim tržnim obsegom, iz člena 3 in člena 8(1)(a), in ki spadajo v enega od podrazredov sredstev iz odstavka 1(a)(ii), so obseg, značilen za finančni instrument, ter velikost naročil in obseg poslov, ki so veliki v primerjavi z običajnim tržnim obsegom, tisti obsegi in velikosti, ki se uporabljajo za najnižji interval povprečnega dnevnega nominalnega zneska (ADNA) za podrazred sredstev, v katerega spada lastniški izvedeni finančni instrument.

15. Za finančne instrumente, ki so uvrščeni v trgovanje ali s katerimi se je prvič trgovalo na mestu trgovanja, ki ne spadajo v nobeno podkategorijo, za katero so se objavili obseg, značilen za finančni instrument, iz člena 8(1), točka (c), ter velikost naročil in obseg poslov, ki so veliki v primerjavi z običajnim tržnim obsegom, iz člena 3 in člena 8(1), točka (a), se do uporabe rezultatov izračunov, opravljenih v skladu z odstavkom 17, šteje, da nimajo likvidnega trga. Relevantni obseg, značilen za finančni instrument, iz člena 8(1), točka (c), ter velikost naročil in obseg poslov, ki so veliki v primerjavi z običajnim tržnim obsegom, iz člena 3 in člena 8(1), točka (a), so obseg in velikost podkategorij, za katere se določi, da nimajo likvidnega trga, ki pripadajo istemu podrazredu sredstev.

▼B

16. Mesta trgovanja pristojnim organom po koncu trgovalnega dne, vendar pred koncem dneva, predložijo podatke iz Priloge IV za izvedbo izračunov iz odstavka 5, kadar je finančni instrument uvrščen v trgovanje ali pa se je z njim prvič trgovalo na navedenem mestu trgovanja oziroma kadar so se podatki, predloženi v preteklosti, spremenili.

▼M3

17. Pristojni organi zagotovijo objavo rezultatov izračunov iz odstavka 5 za vsak finančni instrument in razred finančnih instrumentov do 30. aprila v letu po začetku uporabe Uredbe (EU) št. 600/2014 in do 30. aprila vsako naslednje leto. Rezultati izračunov se uporabljajo od prvega ponedeljka v juniju vsako leto po objavi do dneva pred prvim ponedeljkom junija naslednjega leta.

▼M4

_____

▼B

Člen 14

Posli, za katere velja izvzetje iz člena 1(6) Uredbe (EU) št. 600/2014

(člen 1(6) Uredbe (EU) št. 600/2014)

Za posel se šteje, da ga je članica Evropskega sistema centralnih bank (ESCB) sklenila v okviru izvajanja monetarne politike, politike deviznih poslov in politike za finančno stabilnost, kadar posel izpolnjuje naslednje zahteve:

(a) posel se izvede v okviru monetarne politike, vključno z operacijami, izvedenimi v skladu s členoma 18 in 20 Statuta Evropskega sistema centralnih bank in Evropske centralne banke, ki je priložen Pogodbi o Evropski uniji, ali operacijami, izvedenimi v skladu z enakovrednimi nacionalnimi določbami za članice ESCB v državah članicah, katerih valuta ni euro;

(b) posel je devizni posel, vključno z operacijami za hranjenje in upravljanje uradnih deviznih rezerv držav članic ali storitvami upravljanja rezerv, ki jih članica ESCB zagotavlja centralnim bankam v drugih državah, na katere se je razširilo izvzetje v skladu s členom 1(9) Uredbe (EU) št. 600/2014;

(c) posel se izvede za namene politike za finančno stabilnost.

Člen 15

Posli, za katere izvzetje iz člena 1(6) Uredbe (EU) št. 600/2014 ne velja

(člen 1(7) Uredbe (EU) št. 600/2014)

Člen 1(6) Uredbe (EU) št. 600/2014 ne velja za naslednje vrste poslov, ki jih sklene članica ESCB v okviru izvajanja investicijskih dejavnosti, če niso povezane z izvajanjem ene od nalog navedene članice iz člena 14:

(a) posli, sklenjeni za upravljanje lastnega kapitala;

▼B

(b) posli, sklenjeni za upravne namene ali za zaposlene v članici ESCB, ki vključujejo posle, opravljene v vlogi upravljavca pokojninskega sistema za svoje zaposlene;

(c) posli, sklenjeni za naložbeni portfelj v skladu z obveznostmi po nacionalnem pravu.

▼M4

Člen 16

Začasna opustitev obveznosti glede preglednosti

(člen 9(4) Uredbe (EU) št. 600/2014)

1. Za finančne instrumente, za katere obstaja likviden trg, kot je določen na podlagi metodologije iz člena 6a za obveznice, strukturirane finančne produkte in pravice do emisije ter iz člena 13 za izvedene finančne instrumente, lahko pristojni organi začasno opustijo obveznosti iz členov 8, 8a in 10 Uredbe (EU) št. 600/2014, kadar za razred obveznic, strukturiranih finančnih produktov, pravic do emisije ali izvedenih finančnih instrumentov skupni obseg iz tabele 4 Priloge II, izračunan za predhodnih 30 koledarskih dni, predstavlja manj kot 40 % povprečnega mesečnega obsega, izračunanega za 12 polnih koledarskih mesecev pred navedenimi 30 koledarskimi dnevi.

2. Za finančne instrumente, za katere ne obstaja likviden trg, kot je določen na podlagi metodologije iz člena 6a za obveznice, strukturirane finančne produkte in pravice do emisije ter iz člena 13 za izvedene finančne instrumente, lahko pristojni organi začasno opustijo obveznosti iz členov 8, 8a in 10 Uredbe (EU) št. 600/2014, kadar za razred obveznic, strukturiranih finančnih produktov, pravic do emisije ali izvedenih finančnih instrumentov skupni obseg iz tabele 4 Priloge II, izračunan za predhodnih 30 koledarskih dni, predstavlja manj kot 20 % povprečnega mesečnega obsega, izračunanega za 12 polnih koledarskih mesecev pred navedenimi 30 koledarskimi dnevi.

3. Pristojni organi pri izvajanju izračunov iz odstavkov 1 in 2 upoštevajo posle, izvršene na vseh mestih v Uniji za zadevne razrede obveznic, strukturiranih finančnih produktov, pravic do emisije ali izvedenih finančnih instrumentov. Pristojni organi take izračune izvedejo na ravni razreda finančnih instrumentov, za katerega se uporabi preskus likvidnosti iz člena 6a za obveznice, strukturirane finančne produkte in pravice do emisije ter člena 13 za izvedene finančne instrumente.

4. Pristojni organi pred začasno opustitvijo obveznosti glede preglednosti preverijo, da bistveno zmanjšanje likvidnosti na vseh mestih trgovanja ni posledica sezonskih učinkov zadevnega razreda finančnih instrumentov na likvidnost.

▼B

Člen 19

Začetek veljavnosti in uporaba

Ta uredba začne veljati dvajseti dan po objavi v *Uradnem listu Evropske unije*.

Uporablja se od 3. januarja 2018. Izjema je člen 18, ki se uporablja od datuma začetka veljavnosti te uredbe.

Ta uredba je v celoti zavezujoča in se neposredno uporablja v vseh državah članicah.

▼M4

PRILOGA I

Vrste sistema ter povezane informacije, ki jih je treba objaviti v skladu s členom 2

Vrsta sistema	Informacije, ki jih je treba objaviti
Trgovalni sistem za avtomatsko povezovanje naročil	Za vsak finančni instrument skupno število naročil in obseg, ki ga predstavljajo na vsaki cenovni ravni, za vsaj pet najboljših nakupnih in prodajnih cen.
Trgovalni sistem na podlagi rednih avkcij	Za vsak finančni instrument cena, po kateri bi avkcijski trgovalni sistem najbolje izpolnil zahteve svojega trgovalnega algoritma, in obseg, ki bi ga lahko po tej ceni potencialno izvršili udeleženci v tem sistemu.

▼B

PRILOGA II

Podrobnosti o poslih, ki se morajo objaviti

Tabela 1

Tabela z oblikami zapisa podatkov za tabelo 2

OBLIKA ZAPISA	VRSTA PODATKOV	OPREDELITEV
{ALPHANUM-n}	Do n alfanumeričnih znakov	Polje za prosto besedilo.
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerični znaki	Tričrkovna koda valute, kot je opredeljena s kodo valute po ISO 4217.
{DATE_TIME_FORMAT}	Oblika datuma in ure po ISO 8601	Datum in ura v naslednji obliki: LLLL-MM-DDThh:mm:ss.dddddd Z. Pri tem velja: — „LLLL“ je leto, — „MM“ je mesec, — „DD“ je dan, — „T“ pomeni, da je treba uporabiti črko „T“, — „hh“ je ura, — „mm“ so minute, — „ss.dddddd“ je sekunda in del sekunde, — Z je čas UTC. Datum in ura se poročata v UTC.
{DECIMAL-n/m}	Decimalno število s skupno do n števkami, od katerih je do m števk lahko decimalk.	Numerično polje za pozitivne in negativne vrednosti: — decimalno ločilo je „.“ (pika), — negativne vrednosti imajo predznak „–“ (minus). Kjer je ustrezno, se vrednosti zaokrožijo in se ne skrajšajo.
{ISIN}	12 alfanumeričnih znakov	Koda ISIN, kot je opredeljena v standardu ISO 6166.
{MIC}	4 alfanumerični znaki	Identifikator trga, kot je opredeljen v standardu ISO 10383.

▼M4

Tabela 2

Seznam podatkov, potrebnih za namene preglednosti po trgovanju

Imena polj (glave stolpcev), kot so objavljena, so enaka identifikatorju polja iz tabele 2

Št.	Identifikator polja	Finančni instrumenti	Opis/podatki, ki se morajo objaviti	Vrsta mesta izvršitve ali objave	Oblika zapisa podatkov, ki se uporabi, kot je določena v tabeli 1
1.	Datum in ura trgovanja	Za vse finančne instrumente	Datum in ura, ko se je izvršil posel Za posle, izvršene na mestu trgovanja, je raven podrobnosti v skladu z zahtevami iz člena 12 Delegirane uredbe Komisije (EU) 2025/1155 ([1]). Za posle, ki se ne izvršijo na mestu trgovanja, sta to datum in ura, ko se stranki dogovorita o vsebini naslednjih polj: količina, cena, valute, kot so določene v poljih 31, 34 in 44 tabele 2 Priloge I k Delegirani uredbi (EU) 2017/590, identifikacijska koda instrumenta, razvrstitev instrumenta in koda instrumenta, ki predstavlja osnovo, kadar je ustrezno. Za posle, ki se ne izvršijo na mestu trgovanja, je sporočeni čas posla natančen vsaj do najbližje sekunde. Če je posel izvršen na podlagi naročila, ki ga je podjetje, ki ga izvrši, v imenu stranke posredovalo tretji osebi, pri čemer pogoji za prenos iz člena 4 Delegirane uredbe (EU) 2017/590 niso bili izpolnjeni, je to datum in ura posla in ne datum in ura posredovanja naročila.	Regulirani trg (RM) Večstranski sistem trgovanja (MTF) Organiziran sistem trgovanja (OTF) Sistem odobrenih objav (APA)	{DATE_TIME_ FORMAT}
2.	Identifikacijska koda instrumenta	Za vse finančne instrumente	Koda, ki se uporablja za identifikacijo finančnega instrumenta	RM, MTF, OTF, APA	{ISIN}

▼M4

Št.	Identifikator polja	Finančni instrumenti	Opis/podatki, ki se morajo objaviti	Vrsta mesta izvršitve ali objave	Oblika zapisa podatkov, ki se uporabi, kot je določena v tabeli 1
3.	Cena	Za vse finančne instrumente	Cena posla pri trgovanju, ki izključuje, kadar je ustrezno, provizijo in natekle obresti. Cena pri trgovanju se poroča v skladu s standardno tržno konvencijo. Vrednost, navedena v tem polju, je skladna z vrednostjo, navedeno v polju „Oblika zapisa cene“. Če cena trenutno ni na voljo, ampak je še v pričakovanju (PNDG), ali če cena ni relevantna (NOAP), se polje pusti prazno.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/13}, če je cena izražena kot denarna vrednost {DECIMAL-11/10}, če je cena izražena kot odstotek ali donos {DECIMAL-18/17}, če je cena izražena v bazičnih točkah
4.	Manjkajoča cena	Za vse finančne instrumente	Če cena trenutno ni na voljo, ampak je še v pričakovanju, se navede vrednost „PNDG“. Če podatek o ceni ni relevanten, se navede vrednost „NOAP“.	RM, MTF, OTF, APA	„PNDG“, če cena ni na voljo „NOAP“, če cena ni relevantna
5.	Valuta cene	Za vse finančne instrumente	Glavna valuta, v kateri je izražena cena (relevantno, če je cena izražena kot denarna vrednost).	RM, MTF, OTF, APA	{CURRENCY CODE_3}
6.	Oblika zapisa cene	Za vse finančne instrumente	Navedba, ali je cena izražena kot denarna vrednost, v odstotkih, bazičnih točkah ali kot donos. Oblika zapisa cene se sporoči v skladu s standardno tržno konvencijo. Za kreditne zamenjave se v to polje vnese „BAPO“. Za obveznice (razen ETN in ETC) se v to polje vnese odstotek (PERC) nominalnega zneska. Kadar cena v odstotkih ni standardna tržna konvencija, se v skladu s standardno tržno konvencijo navede YIEL, BAPO ali MONE. Vrednost, navedena v tem polju, je skladna z vrednostjo, navedeno v polju „Cena“. Če je cena sporočena v denarnem znesku, se navede v enotah glavne valute.	RM, MTF, OTF, APA	„MONE“ – denarna vrednost „PERC“ – odstotek „YIEL“ – donos „BAPO“ – bazične točke

▼M4

Št.	Identifikator polja	Finančni instrumenti	Opis/podatki, ki se morajo objaviti	Vrsta mesta izvršitve ali objave	Oblika zapisa podatkov, ki se uporabi, kot je določena v tabeli 1
			Če cena trenutno ni na voljo, ampak je še v pričakovanju (PNDG), ali če cena ni relevantna (NOAP), se polje pusti prazno.		
7.	Količina	Za vse finančne instrumente razen v primerih, opisanih v členu 11(1), točki (a) in (b), te uredbe.	Za finančne instrumente, s katerimi se trguje v enotah, število enot finančnega instrumenta. V nasprotnem primeru se polje pusti prazno.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/17}
8.	Količina v merski enoti	Za pogodbe z izvedenimi finančnimi instrumenti na blago, izražene v enotah, izvedene finančne instrumente C10, izvedene finančne instrumente na pravice do emisije in pravice do emisije, razen v primerih, opisanih v členu 11(1), točki (a) in (b), te uredbe.	Enakovreden znesek blaga ali pravice do emisije, s katerima se trguje, izražen v merski enoti.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/17}
9.	Oblika zapisa količine v merski enoti	Za pogodbe z izvedenimi finančnimi instrumenti na blago, izražene v enotah, izvedene finančne instrumente C10, izvedene finančne instrumente na pravice do emisije in pravice do emisije, razen v primerih, opisanih v členu 11(1), točki (a) in (b), te uredbe.	Navedba oblike zapisa v merski enoti, v kateri je izražena količina.	RM, MTF, OTF, APA	„TOCD“ – tone ekvivalenta ogljikovega dioksida za katero koli pogodbo v zvezi s pravicami do emisije „TONE“ – metrične tone „MWHO“ – megavatne ure „MBTU“ – milijon britanskih toplotnih enot „THMS“ – termalne enote „DAYS“ – dnevi ali {ALPHANUM-4} za drugo

▼M4

Št.	Identifikator polja	Finančni instrumenti	Opis/podatki, ki se morajo objaviti	Vrsta mesta izvršitve ali objave	Oblika zapisa podatkov, ki se uporabi, kot je določena v tabeli 1
10.	Nominalni znesek	Za vse finančne instrumente razen v primerih, opisanih v členu 11(1), točki (a) in (b), te uredbe.	To polje se izpolni: (i) za obveznice (razen ETC in ETN) z nominalno vrednostjo, ki je znesek, ki se ob odkupu vrne vlagatelju; (ii) za ETC in ETN ter listinjene izvedene finančne instrumente s številom instrumentov, izmenjanih med kupci in prodajalci, ki se pomnoži s ceno instrumenta, izmenjanega za zadevni posel. To pomeni s poljem za ceno, pomnoženim s poljem za količino; (iii) za strukturirane finančne produkte z nominalno vrednostjo na enoto, pomnoženo s številom instrumentov v času posla; (iv) za kreditne zamenjave z nominalnim zneskom, za katerega je kupljena ali prodana zaščita. (v) za opcije, opcije na zamenjavo, zamenjave, razen tistih iz točke (iv), standardizirane terminske pogodbe in nestandardizirane terminske pogodbe z nominalnim zneskom pogodbe; (vi) za pravice do emisije z dobljeno količino po zadevni ceni, določeni v pogodbi v času posla. To pomeni s poljem za ceno, pomnoženim s poljem za količino v merski enoti; (vii) za stave na razmik (*spread bet*) z denarnim zneskom, ki se stavi na spremembo v točkah pri finančnem instrumentu, ki predstavlja osnovo, v času posla;	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/5}

▼M4

Št.	Identifikator polja	Finančni instrumenti	Opis/podatki, ki se morajo objaviti	Vrsta mesta izvršitve ali objave	Oblika zapisa podatkov, ki se uporabi, kot je določena v tabeli 1
			(viii) za pogodbe na razliko s številom instrumentov, izmenjanih med kupci in prodajalci, pomnoženim s ceno instrumenta, izmenjanega za zadevni posel. To pomeni s poljem za ceno, pomnoženim s poljem za količino;		
11.	Nominalna valuta	Za vse finančne instrumente razen v primerih, opisanih v členu 11(1), točki (a) in (b), te uredbe.	Glavna valuta, v kateri je denominiran nominalni znesek. V primeru pogodbe o valutnih izvedenih finančnih instrumentih ali večvalutne zamenjave ali opcije na zamenjavo, pri katerih je zamenjava, ki predstavlja osnovo, večvalutna ali valutna finančna pogodba na razliko ali stava na razmik, bo to nominalna valuta strani posla 1.	RM, MTF, OTF, APA	{CURRENCY CODE_3}
12.	[črtano]				
13.	Mesto izvršitve	Za vse finančne instrumente	Navedba mesta, kjer je bil posel izvršen. Uporabite kodo MIC segmenta po ISO 10383 za posle, izvršene na mestu trgovanja v EU. Če koda MIC segmenta ne obstaja, se uporabi koda MIC upravljavca. Kodo SINT uporabite za finančne instrumente, uvrščene v trgovanje ali s katerimi se trguje na mestu trgovanja, kadar se posel s takim finančnim instrumentom izvrši prek sistematičnega internalizatorja. Kodo MIC XOFF uporabite za finančne instrumente, uvrščene v trgovanje ali s katerimi se trguje na mestu trgovanja, kadar se posel s takim finančnim instrumentom ne izvrši na mestu trgovanja v EU ali prek sistematičnega internalizatorja. Če se posel izvrši na organizirani trgovalni platformi zunaj EU, je poleg XOFF treba izpolniti tudi polje „Mesto trgovanja v tretji državi, kjer je izvršen posel“.	RM, MTF, OTF, APA	{MIC} – mesta trgovanja v EU ali „SINT“ – sistematični internalizator „XOFF“ – za drugo

▼M4

Št.	Identifikator polja	Finančni instrumenti	Opis/podatki, ki se morajo objaviti	Vrsta mesta izvršitve ali objave	Oblika zapisa podatkov, ki se uporabi, kot je določena v tabeli 1
14.	Mesto trgovanja v tretji državi, kjer je izvršen posel	Za vse finančne instrumente	Navedba mesta trgovanja v tretji državi, kjer je bil posel izvršen. Uporabite kodo MIC segmenta po ISO 10383. Če koda MIC segmenta ne obstaja, se uporabi koda MIC upravljavca. Če posel ni izvršen na mestu trgovanja v tretji državi, se polje pusti prazno.	APA	{MIC}
15.	Datum in ura objave	Za vse finančne instrumente	Datum in ura, ko je mesto trgovanja ali APA objavil posel. Za posle, izvršene na mestu trgovanja, je raven podrobnosti v skladu z zahtevami iz člena 12 Delegirane uredbe (EU) 2025/1155. Za posle, ki se ne izvršijo na mestu trgovanja, je sporočeni čas posla natančen vsaj do najbližje sekunde.	RM, MTF, OTF, APA	{DATE_TIME_FORMAT}
16.	Mesto objave	Za vse finančne instrumente	Koda, ki se uporablja za identifikacijo mesta trgovanja in APA, ki objavi posel.	RM, MTF, OTF, APA	{MIC}
17.	Identifikacijska koda posla	Za vse finančne instrumente	Alfanumerična koda, ki jo poslu pripišejo mesta trgovanja (v skladu s členom 12 Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/580 ([2]) in APA ter ki se uporablja pri vsakem naknadnem sklicevanju na ta konkreten posel.	RM, MTF, OTF, APA	{ALPHA NUMERICAL-52}
18.	Za posel se bo opravil kliring	Za izvedene finančne instrumente	Koda, ki navaja, ali se bo za posel opravil kliring.	RM, MTF, OTF, APA	„TRUE“ – za posel se bo opravil kliring „FALSE“ – za posel se ne bo opravil kliring

▼M4

Št.	Identifikator polja	Finančni instrumenti	Opis/podatki, ki se morajo objaviti	Vrsta mesta izvršitve ali objave	Oblika zapisa podatkov, ki se uporabi, kot je določena v tabeli 1
19.	Oznake	Za vse finančne instrumente	V enem ali več poljih je treba navesti ustrezne oznake, kot je opisano v tabeli 3 Priloge II. Kadar ne velja nobena od navedenih okoliščin, je treba posel objaviti brez oznake. Kadar je možna kombinacija oznak, ki se poroča v enem polju, je treba oznake poročati ločene z vejicami.	RM, MTF, OTF, APA	Kot je določeno v tabeli 3 Priloge II
20.	Trgovalni sistem	Za vse finančne instrumente	Vrsta trgovalnega sistema, v katerem je bil posel izvršen. Kadar je v polju „Mesto izvršitve“ naveden „SINT“ ali „XOFF“, se to polje ne izpolni.	RM, MTF, OTF	„CLOB“ – trgovalni sistem na podlagi centralne knjige naročil z omejitvami. „QDTS“ – trgovalni sistem na podlagi ponudb, ki pomeni sistem, pri katerem se posli sklepajo na podlagi zavezujočih ponudb, ki se neprekinjeno dajejo na razpolago udeležencem, kar od vzdrževalcev trga zahteva, da ohranjajo ponudbe v taki velikosti, ki zagotavlja ravnotežje med potrebami članov in udeležencev po trgovanju s komercialnimi količinami in tveganjem, ki se mu izpostavlja vzdrževalec trga. „PATS“ – trgovalni sistem na podlagi rednih avkcij. „RFQT“ – trgovalni sistem na podlagi zahtevkov za ponudbe je trgovalni sistem, pri katerem se ponudba ali ponudbe podajo v odziv na zahtevek za ponudbo, ki ga odda eden ali več drugih članov ali udeležencev. Ponudbo lahko izvrši izključno član ali udeleženec mesta trgovanja, ki je podal zahtevek. Član ali udeleženec mesta trgovanja, ki je zahteval ponudbo, lahko sklene posel s sprejetjem ponudbe ali ponudb, ki so mu bile podane na zahtevo.

▼M4

Št.	Identifikator polja	Finančni instrumenti	Opis/podatki, ki se morajo objaviti	Vrsta mesta izvršitve ali objave	Oblika zapisa podatkov, ki se uporabi, kot je določena v tabeli 1
					„VOIC“ – sistem za glasovno trgovanje, ki pomeni trgovalni sistem, pri katerem se posli med člani dogovorijo z glasovnim pogajanjem. „HYBR“ – hibridni trgovalni sistem je sistem, ki spada v dve ali več zgoraj navedenih vrst trgovalnih sistemov. „OTHR“ – kateri koli drug trgovalni sistem, kar pomeni katero koli drugo vrsto trgovalnega sistema, ki ni zajet zgoraj.
21.	Število poslov	Za državne dolžniške instrumente	V tem polju se navede število izvršenih poslov, kadar se v skladu s členom 11(3)(b) Uredbe (EU) št. 600/2014 zahteva odlog objave podrobnosti več poslov v agregirani obliki.	RM, MTF, OTF, APA	{DECIMAL-18/17}

([1]) Delegirana Uredba Komisije (EU) 2025/1155 z dne 12. junija 2025 o dopolnitvi Uredbe (EU) št. 600/2014 Evropskega parlamenta in Sveta v zvezi z regulativnimi tehničnimi standardi, ki določajo vhodne in izhodne podatke sistemov stalnih informacij, uskladitev poslovnih ur in prerazdelitev prihodkov s strani ponudnika stalnih informacij za delnice in ETF, ter o razveljavitvi Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/574 (UL L, 2025/1155, 3. 11. 2025, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2025/1155/oj).

([2]) Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/580 z dne 24. junija 2016 o dopolnitvi Uredbe (EU) št. 600/2014 Evropskega parlamenta in Sveta v zvezi z regulativnimi tehničnimi standardi glede hranjenja pomembnih podatkov o naročilih za finančne instrumente (UL L 87, 31.3.2017, str. 193, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/580/oj).

▼M4

Tabela 3

Seznam oznak za potrebe preglednosti po trgovanju

OZNAKE ZA ODLOG PO TRGOVANJU ZA IZVEDENE FINANČNE INSTRUMENTE

Oznaka	Naziv oznake	Vrsta mesta izvršitve ali objave	Opis
„LRGS“	Oznaka velikega posla z odlogom objave (*Post-trade LIS transaction*)	RM, MTF, OTF, APA	Posli, ki se izvršijo na podlagi odloga objave po trgovanju zaradi velikosti.
„ILQD“	Oznaka posla z nelikvidnimi instrumenti (*Illiquid instrument transaction*)	RM, MTF, OTF, APA	Posli, ki se izvršijo na podlagi odloga objave za instrumente, za katere ne obstaja likviden trg.
„SIZE“	Oznaka poslov z odlogom objave zaradi značilnega obsega (*Post-trade SSTI transaction*)	RM, MTF, OTF, APA	Posli, ki se izvršijo na podlagi odloga objave po trgovanju zaradi značilnega obsega instrumenta.

OZNAKE ZA ODLOG PO TRGOVANJU ZA OBVEZNICE (RAZEN ETC IN ETN)

Oznaka	Naziv oznake	Vrsta mesta izvršitve ali objave	Opis
MLF1	Oznaka poslov srednjega obsega z likvidnim trgom	RM, MTF, OTF, APA	Posli z obveznicami, za katere velja odlog, ki se uporablja za posle srednjega obsega s finančnim instrumentom, za katerega obstaja likviden trg, v skladu s členom 8a(1), točka (a), te uredbe.
MIF2	Oznaka poslov srednjega obsega z nelikvidnim trgom	RM, MTF, OTF, APA	Posli z obveznicami, za katere velja odlog, ki se uporablja za posle srednjega obsega s finančnim instrumentom, za katerega ni likvidnega trga, v skladu s členom 8a(1), točka (b), te uredbe.
LLF3	Oznaka poslov velikega obsega z likvidnim trgom	RM, MTF, OTF, APA	Posli z obveznicami, za katere velja odlog, ki se uporablja za posle velikega obsega s finančnim instrumentom, za katerega obstaja likviden trg, v skladu s členom 8a(1), točka (c), te uredbe.
LIF4	Oznaka poslov velikega obsega z nelikvidnim trgom	RM, MTF, OTF, APA	Posli z obveznicami, za katere velja odlog, ki se uporablja za posle velikega obsega s finančnim instrumentom, za katerega ni likvidnega trga, v skladu s členom 8a(1), točka (d), te uredbe.

▼M4

OZNAKE ZA ODLOG PO TRGOVANJU ZA OBVEZNICE (RAZEN ETC IN ETN)

Oznaka	Naziv oznake	Vrsta mesta izvršitve ali objave	Opis
VLF5	Oznaka poslov zelo velikega obsega z likvidnim trgom	RM, MTF, OTF, APA	Posli z obveznicami, za katere velja odlog, ki se uporablja za posle zelo velikega obsega s finančnim instrumentom, za katerega obstaja likviden trg, v skladu s členom 8a(1), točka (e), te uredbe.
VIF5	Oznaka poslov zelo velikega obsega z nelikvidnim trgom	RM, MTF, OTF, APA	Posli z obveznicami, za katere velja odlog, ki se uporablja za posle zelo velikega obsega s finančnim instrumentom, za katerega ni likvidnega trga, v skladu s členom 8a(1), točka (e), te uredbe.

OZNAKE ZA ODLOG PO TRGOVANJU ZA ETC, ETN, STRUKTURIRANE FINANČNE PRODUKTE IN PRAVICE DO EMISIJE

Oznaka	Naziv oznake	Vrsta mesta izvršitve ali objave	Opis
DEFF	Odlog za ETC, ETN, strukturirane finančne produkte in pravice do emisije	RM, MTF, OTF, APA	Posli z ETC, ETN, strukturiranimi finančnimi produkti in pravicami do emisije, za katere velja odlog iz člena 8a(2) in (3) te uredbe.

DODATNE OZNAKE ZA ODLOG ZA IZVEDENE FINANČNE INSTRUMENTE

Člen 11(1), točka (a)(i)	„LMTF“	Oznaka o omejenih podrobnostih	RM, MTF, OTF, APA	Prvo poročilo z objavo omejenih podrobnosti v skladu s členom 11(1), točka (a)(i).
	„FULF“	Oznaka o popolnih podrobnostih	RM, MTF, OTF, APA	Posel, za katerega so bile prej objavljene omejene podrobnosti v skladu s členom 11(1), točka (a)(i).
Člen 11(1), točka (a)(ii)	„DATF“	Oznaka o dnevnih poslih v agregirani obliki	RM, MTF, OTF, APA	Objava dnevnih poslov v agregirani obliki v skladu s členom 11(1), točka (a)(ii).
	„FULA“	Oznaka o popolnih podrobnostih	RM, MTF, OTF, APA	Posamezni posli, za katere so bile prej objavljene podrobnosti v agregirani obliki v skladu s členom 11(1), točka (a)(ii).

▼M4

DODATNE OZNAKE ZA ODLOG ZA IZVEDENE FINANČNE INSTRUMENTE				
Člen 11(1), točka (b)	„VOLO“	Oznaka o neobjavljenem obsegu	RM, MTF, OTF, APA	Posel, za katerega se objavijo omejene podrobnosti v skladu s členom 11(1), točka (b).
	„FULV“	Oznaka o popolnih podrobnostih	RM, MTF, OTF, APA	Posel, za katerega so bile prej objavljene omejene podrobnosti v skladu s členom 11(1), točka (b).
Člen 11(1), točka (c)	„FWAF“	Oznaka objave poslov v agregatni obliki v obdobju štirih tednov	RM, MTF, OTF, APA	Objava poslov v agregirani obliki v skladu s členom 11(1), točka (c).
	„FULJ“	Oznaka o popolnih podrobnostih	RM, MTF, OTF, APA	Posamezni posli, za katere se je prej lahko uporabljalo objavljanje podrobnosti v agregirani obliki v skladu s členom 11(1), točka (c).

DODATNE OZNAKE ZA ODLOG ZA DRŽAVNE OBVEZNICE				
Člen 11(3)(a)	„OMIS“	Oznaka o neobjavljenem obsegu	RM, MTF, OTF, APA	Posel, za katerega so v skladu s členom 11(3), točka (a), Uredbe (EU) št. 600/2014 objavljene omejene podrobnosti.
	„FULO“	Oznaka o popolnih podrobnostih	RM, MTF, OTF, APA	Posel, za katerega so bile v skladu s členom 11(3), točka (a), Uredbe (EU) št. 600/2014 prej objavljene omejene podrobnosti.
Člen 11(3)(b)	„AGFW“	Oznaka objave poslov v agregatni obliki v obdobju štirih tednov	RM, MTF, OTF, APA	Objava poslov v agregirani obliki v skladu s členom 11(3), točka (b), Uredbe (EU) št. 600/2014.
	„FULG“	Oznaka o popolnih podrobnostih	RM, MTF, OTF, APA	Posamezni posli, za katere se je prej uporabljalo objavljanje v agregirani obliki v skladu s členom 11(3), točka (b), Uredbe (EU) št. 600/2014.

DRUGE OZNAKE

Oznaka	Naziv oznake	Vrsta mesta izvršitve ali objave	Opis
„BENC“	Oznaka referenčnega posla (*Benchmark transaction*)	RM, MTF, OTF, APA	Posli, izvršeni na podlagi cene, ki se izračuna v več časovnih točkah glede na ustrezno referenčno merilo, kot je povprečna cena, tehtana glede na obseg, ali povprečna cena, tehtana glede na čas.
„NPFT“	Oznaka posla, ki ne prispeva k oblikovanju cene (*Non-price forming transaction*)	RM, MTF, OTF, APA	Posli, ki ne prispevajo k oblikovanju cen, kot so določeni v členu 2(5) Delegirane uredbe (EU) 2017/590.

▼M4

DRUGE OZNAKE

Oznaka	Naziv oznake	Vrsta mesta izvršitve ali objave	Opis
„TPAC“	Oznaka paketnega	RM, MTF, OTF, APA	Paketni posli, ki ne vključujejo zamenjave za fizična sredstva, kot so opredeljeni v členu 2(1), točka 50(b), Uredbe (EU) št. 600/2014.
„XFPH“	Oznaka posla zamenjave za fizična sredstva (*Exchange for physicals transaction*)	RM, MTF, OTF, APA	Zamenjava za fizična sredstva, kot je opredeljena v členu 2(1), točka 48, Uredbe (EU) št. 600/2014.
„CANC“	Oznaka o preklicu	RM, MTF, OTF, APA	Kadar se prej objavljen posel prekliče.
„AMND“	Oznaka o spremembi	RM, MTF, OTF, APA	Kadar se prej objavljen posel spremeni.
„PORT“	Oznaka za portfeljske posle	RM, MTF, OTF, APA	Posel s petimi ali več različnimi finančnimi instrumenti, pri čemer z navedenimi posli hkrati trguje ista stranka, z njimi pa se trguje kot z eno enoto za določeno referenčno ceno, pri čemer to ni „paketni posel“, kot je določen v členu 2(1), točka 50, Uredbe (EU) št. 600/2014.
„MTCH“	Oznaka za trgovanje s hkratnim nakupom in prodajo	OTF	Posli trgovanja s hkratnim nakupom in prodajo, kot so določeni v členu 4(1), točka 38, Direktive 2014/65/EU.
„NEGO“	Oznaka posla, dogovorjenega v pogajanjih	RM, MTF, OTF	Posli, o katerih se pogaja zasebno, vendar se o njih poroča v skladu s pravili mesta trgovanja.

▼M3

Tabela 4

Mere obsega

Vrsta instrumenta	Obseg
Vse obveznice razen instrumentov na blago in zapisov, s katerimi se trguje na borzi (*Exchange Traded Commodities* – ETC, *Exchange Traded Notes* – ETN), ter strukturiranih finančnih produktov	„Nominalni znesek“ trgovane pogodbe, kot je naveden v polju 10 tabele 2 Priloge II k tej uredbi.
Dolžniški vrednostni papirji vrste ETC in ETN	„Nominalni znesek“ trgovane pogodbe, kot je naveden v polju 10 tabele 2 Priloge II k tej uredbi.
Listinjeni izvedeni finančni instrumenti	„Nominalni znesek“ trgovane pogodbe, kot je naveden v polju 10 tabele 2 Priloge II k tej uredbi.
Obrestni izvedeni finančni instrumenti	„Nominalni znesek“ trgovane pogodbe, kot je naveden v polju 10 tabele 2 Priloge II k tej uredbi.
Valutni izvedeni finančni instrumenti	„Nominalni znesek“ trgovane pogodbe, kot je naveden v polju 10 tabele 2 Priloge II k tej uredbi.
Lastniški izvedeni finančni instrumenti	„Nominalni znesek“ trgovane pogodbe, kot je naveden v polju 10 tabele 2 Priloge II k tej uredbi.
Izvedeni finančni instrumenti na blago	„Nominalni znesek“ trgovane pogodbe, kot je naveden v polju 10 tabele 2 Priloge II k tej uredbi.
Kreditni izvedeni finančni instrumenti	„Nominalni znesek“ trgovane pogodbe, kot je naveden v polju 10 tabele 2 Priloge II k tej uredbi.
Finančne pogodbe na razliko	„Nominalni znesek“ trgovane pogodbe, kot je naveden v polju 10 tabele 2 Priloge II k tej uredbi.
Izvedeni finančni instrumenti C10	„Nominalni znesek“ trgovane pogodbe, kot je naveden v polju 10 tabele 2 Priloge II k tej uredbi.
Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije	„Količina v merski enoti“, kot je navedena v polju 8 tabele 2 Priloge II k tej uredbi.
Pravice do emisije	„Količina v merski enoti“, kot je navedena v polju 8 tabele 2 Priloge II k tej uredbi.

▼B

PRILOGA III

Ocena likvidnosti, pragovi za velike posle in značilen obseg za nelastniške finančne instrumente

▼M4

1. **Navodila za namene te priloge**

1. Sklic na velikost neporavnane izdaje obveznic v tabeli 2.2 se nanaša na skupno vrednost obveznic, ki so bile izdane in so trenutno v posesti vlagateljev.

2. Sklic na „razred sredstev“ pomeni sklic na naslednje razrede finančnih instrumentov: obveznice, strukturirani finančni produkti, listinjeni izvedeni finančni instrumenti, obrestni izvedeni finančni instrumenti, lastniški izvedeni finančni instrumenti, izvedeni finančni instrumenti na blago, valutni izvedeni finančni instrumenti, kreditni izvedeni finančni instrumenti, izvedeni finančni instrumenti C10, finančne pogodbe na razliko, pravice do emisije in izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije.

3. Sklic na „podrazred sredstev“ pomeni sklic na razred sredstev, ki je podrobneje razčlenjen na podlagi vrste pogodbe in/ali vrste osnove.

4. Sklic na „podkategorijo“ pomeni sklic na podrazred sredstev, ki je podrobneje razčlenjen na podlagi dodatnih kvalitativnih meril za razčlenitev, kot je določeno v tabelah 2.2 do 13.3 te priloge.

5. „Povprečen dnevni nominalni znesek (*Average Daily Notional Amount* – ADNA)“ pomeni skupni nominalni znesek za specifičen finančni instrument, ki se določi glede na mero obsega iz tabele 4 Priloge II, izvršen v obdobju, določenem v členu 13(7), deljen s številom trgovalnih dni v navedenem obdobju ali, kadar je ustrezno, v tistem delu leta, v katerem je bil finančni instrument uvrščen v trgovanje oziroma se je z njim trgovalo na mestu trgovanja in v katerem se trgovanje z njim ni začasno ustavilo.

6. „Povprečno dnevno število poslov“ pomeni skupno število poslov, izvršenih s specifičnim finančnim instrumentom v obdobju, določenem v členu 13(7), deljeno s številom trgovalnih dni v navedenem obdobju ali, kadar je ustrezno, v tistem delu leta, v katerem je bil finančni instrument uvrščen v trgovanje oziroma se je z njim trgovalo na mestu trgovanja in v katerem se trgovanje z njim ni začasno ustavilo.

7. „Standardizirana terminska pogodba“ pomeni pogodbo za nakup ali prodajo blaga ali finančnega instrumenta na določen datum v prihodnosti po ceni, dogovorjeni ob sklenitvi pogodbe med kupcem in prodajalcem. Vsaka standardizirana terminska pogodba vsebuje standardne pogoje, ki navajajo najmanjšo količino in kakovost pri nakupu ali prodaji, najmanjši znesek, za katerega se lahko spremeni cena, postopke izročitve, datum zapadlosti in druge značilnosti v zvezi s pogodbo.

8. „Opcija“ pomeni pogodbo, ki daje imetniku pravico, ne pa obveze, da kupi (nakupna opcija) ali proda (prodajna opcija) določen finančni instrument ali blago po vnaprej določeni ceni, tj. izvršilni ceni, na ali do določenega datuma v prihodnosti, tj. datuma izvršitve.

9. „Zamenjava“ pomeni pogodbo, pri kateri se dve stranki dogovorita, da bosta zamenjali denarne tokove iz enega finančnega instrumenta za denarne tokove iz drugega finančnega instrumenta na določen datum v prihodnosti.

10. „Portfeljska zamenjava“ pomeni pogodbo, na podlagi katere lahko končni uporabniki trgujejo z več zamenjavami.

▼**M4**

11. „Nestandardizirana terminska pogodba“ pomeni zasebno pogodbo med dvema strankama za nakup ali prodajo blaga ali finančnega instrumenta na določen datum v prihodnosti po ceni, dogovorjeni ob sklenitvi pogodbe med kupcem in prodajalcem.

12. „Opcija na zamenjavo“ pomeni pogodbo, ki daje imetniku pravico, ne pa obveze, da sklene zamenjavo na ali do določenega datuma v prihodnosti oz. datuma izvršitve.

13. „Standardizirana terminska pogodba na zamenjavo“ pomeni standardizirano terminsko pogodbo, ki imetnika obvezuje, da sklene zamenjavo na določen datum v prihodnosti ali do njega.

14. „Nestandardizirana terminska pogodba na zamenjavo“ pomeni nestandardizirano terminsko pogodbo, ki imetnika obvezuje, da sklene zamenjavo na določen datum v prihodnosti ali do njega.

▼M4

2. **Obveznice**

Tabela 2.2

Obveznice (vse vrste obveznic razen ETC in ETN) – razredi, za katere ne obstaja likviden trg

Za posamezno obveznico se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6a, če je zanjo značilna specifična kombinacija značilnosti obveznice, kot je določeno v vsaki vrstici v spodnjih tabelah.

Državne in druge javne obveznice						
ID skupine	**ID MiFIR**	**Vrsta obveznice**	**Izdajatelj ali država izdajateljica**	**Preostala zapadlost**	**Vrsta kupona**	**Velikost neporavnane izdaje**
	RTS2#3	RTS2#9	Država izdajatelja, navedenega v polju „Identifikator izdajatelja ali upravljavca mesta trgovanja“ v Delegirani uredbi Komisije (EU) 2017/585 ([1]) (RTS23)	Preostali čas do datuma zapadlosti, navedenega v polju RTS23 „Datum zapadlosti“	Tretja črka kode CFI, navedene v polju RTS23 „Razvrstitev instrumenta“	Polje RTS23 „Skupni izdan nominalni znesek“, pretvorjen v EUR
G1	OBVEZNICA	EUSB EUSB pomeni obveznico, ki ni niti zamenljiva niti krita obveznica in jo izda državni izdajatelj, ki je eno od naslednjega: (a) Unija; (b) država članica, vključno z vladnim oddelkom, agencijo ali pravnim subjektom s posebnim namenom v državi članici; (c) v primeru zvezne države članice ena od zveznih enot; (d) pravni subjekt s posebnim namenom za več držav članic; (e) mednarodna finančna institucija, ki sta jo ustanovili dve ali več držav članic in ima namen zagotoviti financiranje in finančno pomoč za svoje članice, ki imajo resne finančne težave ali jim te grozijo; (f) Evropska investicijska banka; (g) suvereni subjekt tretje države.	Država izdajateljica je država članica, Združene države Amerike ali Združeno kraljestvo ALI izdajateljica je Unija.	do vključno 10 let	F (fiksni kupon)	manj kot 5 000 000 000 EUR
G2	OBVEZNICA	EUSB ali OEPB OEPB pomeni obveznico, ki ni niti zamenljiva niti krita obveznica in jo izda javni subjekt, ki ni državni izdajatelj.	Kateri koli instrument, ki ni v skupini G1			manj kot 1 000 000 000 EUR

([1]) Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/585 z dne 14. julija 2016 o dopolnitvi Uredbe (EU) št. 600/2014 Evropskega parlamenta in Sveta v zvezi z regulativnimi tehničnimi standardi za standarde podatkov in oblike referenčnih podatkov o finančnih instrumentih ter tehnične ukrepe v zvezi z ureditvami, ki jih vzpostavijo Evropski organ za vrednostne papirje in trge ter pristojni organi (UL L 87, 31.3.2017, str. 368, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2017/585/oj).

▼M4

Podjetniške, zamenljive in druge obveznice					
ID skupine	**ID MiFIR**	**Vrsta obveznice**	**Valuta**	**Bonitetna ocena**	**Velikost neporavnane izdaje**
	RTS2#3	RTS2#9	Valuta instrumenta, navedena v polju RTS23 „Nominalna valuta 1“		Polje RTS23 „Skupni izdan nominalni znesek“, pretvorjen v EUR
G3	OBVEZNICA	CRPB, CVTB ali OTHR CRPB pomeni obveznico, ki ni niti zamenljiva niti krita obveznica in jo izda evropska delniška družba (Societas Europaea), ustanovljena v skladu z Uredbo Sveta (ES) št. 2157/2001 ([1]), ali vrsta podjetja, navedena v Prilogi I ali Prilogi II k Direktivi 2013/34/EU Evropskega parlamenta in Sveta ([2]), oziroma enakovredno podjetje iz tretje države. CVTB pomeni instrument, ki ga sestavlja obveznica ali listinjen dolžniški instrument z vgrajenim izvedenim finančnim instrumentom, kot je opcija za nakup lastniškega instrumenta, ki predstavlja osnovo.	EUR, GBP, USD	naložbeni razred	manj kot 500 000 000 EUR
G4	OBVEZNICA	CRPB, CVTB ali OTHR	Kateri koli instrument, ki ni v skupini G3		manj kot 500 000 000 EUR

([1]) Uredba Sveta (ES) št. 2157/2001 z dne 8. oktobra 2001 o statutu evropske družbe (SE) (UL L 294, 10.11.2001, str. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2001/2157/oj).
([2]) Direktiva 2013/34/EU Evropskega parlamenta in Sveta z dne 26. junija 2013 o letnih računovodskih izkazih, konsolidiranih računovodskih izkazih in povezanih poročilih nekaterih vrst podjetij, spremembi Direktive 2006/43/ES Evropskega parlamenta in Sveta ter razveljavitvi direktiv Sveta 78/660/EGS in 83/349/EGS (UL L 182, 29.6.2013, str. 19, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2013/34/oj).

Krite obveznice			
ID skupine	**ID MiFIR**	**Vrsta obveznice**	**Velikost neporavnane izdaje**
	RTS2#3	RTS2#9	Polje RTS23 „Skupni izdan nominalni znesek“, pretvorjen v EUR
G5	OBVEZNICA	CVDB CVDB pomeni obveznice iz člena 52 ([1]) Direktive 2009/65/ES Evropskega parlamenta in Sveta ([1]).	manj kot 500 000 000 EUR

([1]) Direktiva 2009/65/ES Evropskega parlamenta in Sveta z dne 13. julija 2009 o usklajevanju zakonov in drugih predpisov o kolektivnih naložbenih podjemih za vlaganja v prenosljive vrednostne papirje (KNPVP) (UL L 302, 17.11.2009, str. 32, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2009/65/oj).

▼M4

Tabela 2.3

Obveznice (vse vrste obveznic razen ETC in ETN) – pragovi za velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem

Razred sredstev – Obveznice (vse vrste obveznic razen ETC in ETN)	
Vrsta obveznice	**LIS, pred trgovanjem**
Državne obveznice in druge javne obveznice	5 000 000 EUR
Podjetniške obveznice, zamenljive obveznice in druge obveznice	1 000 000 EUR
Krita obveznica	5 000 000 EUR

Tabela 2.4

Obveznice (vrste ETC in ETN) – razredi, ki nimajo likvidnega trga

Razred sredstev – Obveznice (vrste ETC in ETN)	
Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6a šteje, da nimajo likvidnega trga, se uporabi naslednja metodologija:	
Instrumenti na blago, s katerimi se trguje na borzi (*Exchange Traded Commodities*, ETC) – RTS2#3 = ETCS: dolžniški instrument, ki se izda na podlagi neposredne naložbe izdajatelja v blago ali izvedene finančne instrumente na blago. Cena ETC je neposredno ali posredno vezana na uspešnost sredstva, ki predstavlja osnovo. ETC pasivno sledi uspešnosti blaga ali indeksa na blago, na katerega se nanaša.	za vse ETC se šteje, da nimajo likvidnega trga
Zapisi, s katerimi se trguje na borzi (*Exchange Traded Note*s, ETN) – RTS2#3 = ETNS: dolžniški instrument, ki se izda na podlagi neposredne naložbe izdajatelja v osnovo ali izvedene finančne instrumente, ki predstavljajo osnovo. Cena ETN je neposredno ali posredno vezana na uspešnost sredstva, ki predstavlja osnovo. ETN pasivno sledi uspešnosti osnove, na katero se nanaša.	za vse ETN se šteje, da nimajo likvidnega trga

Tabela 2.5

Obveznice (vrste ETC in ETN) – prag za velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem

Razred sredstev – Obveznice (vrste ETC in ETN)	
Vrsta obveznice	**LIS, pred trgovanjem**
ETC	1 000 000 EUR
ETN	1 000 000 EUR

▼M4

Tabela 2.6

Obveznice (vse vrste obveznic razen ETC in ETN) – ureditev odloga

Razred sredstev – Obveznice (vse vrste obveznic razen ETC in ETN)			
Vrsta obveznice	**Kategorija**	**Likvidnost**	**Velikost (nad ali enaka)**
Državne obveznice v skupini G1 v skladu s tabelo 2.2	1	šteje se, da imajo likviden trg	15 000 000 EUR
	2	šteje se, da nimajo likvidnega trga	5 000 000 EUR
	3	šteje se, da imajo likviden trg	50 000 000 EUR
	4	šteje se, da nimajo likvidnega trga	15 000 000 EUR
	5	šteje se, da imajo likviden trg	100 000 000 EUR
	5	šteje se, da nimajo likvidnega trga	50 000 000 EUR
Državne obveznice in druge javne obveznice v skupini G2 v skladu s tabelo 2.2	1	šteje se, da imajo likviden trg	10 000 000 EUR
	2	šteje se, da nimajo likvidnega trga	1 000 000 EUR
	3	šteje se, da imajo likviden trg	20 000 000 EUR
	4	šteje se, da nimajo likvidnega trga	2 000 000 EUR
	5	šteje se, da imajo likviden trg	50 000 000 EUR
	5	šteje se, da nimajo likvidnega trga	5 000 000 EUR
Podjetniške obveznice, zamenljive obveznice in druge obveznice v skupini G3 v skladu s tabelo 2.2	1	šteje se, da imajo likviden trg	1 500 000 EUR
	2	šteje se, da nimajo likvidnega trga	500 000 EUR
	3	šteje se, da imajo likviden trg	7 500 000 EUR
	4	šteje se, da nimajo likvidnega trga	2 000 000 EUR
	5	šteje se, da imajo likviden trg	15 000 000 EUR
	5	šteje se, da nimajo likvidnega trga	5 000 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Obveznice (vse vrste obveznic razen ETC in ETN)			
Vrsta obveznice	**Kategorija**	**Likvidnost**	**Velikost (nad ali enaka)**
Podjetniške obveznice, zamenljive obveznice in druge obveznice v skupini G4 v skladu s tabelo 2.2	1	šteje se, da imajo likviden trg	1 000 000 EUR
	2	šteje se, da nimajo likvidnega trga	500 000 EUR
	3	šteje se, da imajo likviden trg	5 000 000 EUR
	4	šteje se, da nimajo likvidnega trga	2 000 000 EUR
	5	šteje se, da imajo likviden trg	10 000 000 EUR
	5	šteje se, da nimajo likvidnega trga	5 000 000 EUR
Krite obveznice v skupini G5 v skladu s tabelo 2.2	1	šteje se, da imajo likviden trg	5 000 000 EUR
	2	šteje se, da nimajo likvidnega trga	1 000 000 EUR
	3	šteje se, da imajo likviden trg	20 000 000 EUR
	4	šteje se, da nimajo likvidnega trga	5 000 000 EUR
	5	šteje se, da imajo likviden trg	50 000 000 EUR
	5	šteje se, da nimajo likvidnega trga	10 000 000 EUR

3. **Strukturirani finančni produkti (SFP)**

Tabela 3.1

SFP – razredi, ki nimajo likvidnega trga

Razred sredstev – Strukturirani finančni produkti (SFP)
Ocena razreda sredstev SFP za namene določitve finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6a šteje, da nimajo likvidnega trga – RTS2#3 = SFPS.
Za vse SFP se šteje, da nimajo likvidnega trga

Tabela 3.2

SFP – prag za velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem

Razred sredstev – Strukturirani finančni produkti (SFP)
LIS, pred trgovanjem
250 000 EUR

▼B

4. **Listinjeni izvedeni finančni instrumenti**

▼M3

Tabela 4.1

Listinjeni izvedeni finančni instrumenti – razredi, ki nimajo likvidnega trga

Razred sredstev – Listinjeni izvedeni finančni instrumenti
pomeni prenosljiv vrednostni papir, kot je opredeljen v členu 4(1)(44)(c) Direktive 2014/65/EU, ki se razlikuje od strukturiranih finančnih produktov in vključuje vsaj:
(a.1) navadne krite nakupne bone (*plain vanilla covered warrants*), ki so vrednostni papirji, ki jih izda finančna institucija in dajejo imetniku pravico, ne pa obveze, da
(a) na datum izteka ali do njega kupi določeno količino sredstva, ki predstavlja osnovo, po vnaprej določeni izvršilni ceni ali, če je bila dogovorjena denarna poravnava, od prodajalca prejme plačilo pozitivne razlike med trenutno tržno in izvršilno ceno; ali
(b) na datum izteka ali do njega proda določeno količino sredstva, ki predstavlja osnovo, po vnaprej določeni izvršilni ceni ali, če je bila dogovorjena denarna poravnava, od kupca prejme plačilo pozitivne razlike med trenutno izvršilno in tržno ceno;
(a.2) nakupne bone, ki pomenijo vrednostne papirje, ki jih je izdal isti izdajatelj osnovnega sredstva in ki dajejo imetniku pravico, ne pa obveze, da
(a) na datum izteka ali do njega kupi določeno količino sredstva, ki predstavlja osnovo, po vnaprej določeni izvršilni ceni ali, če je bila dogovorjena denarna poravnava, od prodajalca prejme plačilo pozitivne razlike med trenutno tržno in izvršilno ceno; ali
(b) na datum izteka ali do njega proda določeno količino sredstva, ki predstavlja osnovo, po vnaprej določeni izvršilni ceni ali, če je bila dogovorjena denarna poravnava, od kupca prejme plačilo pozitivne razlike med trenutno izvršilno in tržno ceno;
(b) potrdila s finančnim vzvodom (leverage certificates), ki so potrdila, ki sledijo uspešnosti sredstva, ki predstavlja osnovo, z učinkom finančnega vzvoda;
(c) eksotične krite nakupne bone (*exotic covered warrants*), ki so kriti nakupni boni, katerih glavna sestavina je kombinacija opcij;
(d) prenosljive pravice, katerih osnova je nelastniški instrument;
(e) naložbene certifikate (*investment certificates*), ki so certifikati, ki sledijo uspešnosti sredstva, ki predstavlja osnovo, brez učinka finančnega vzvoda.
RTS2#3 = SDRV
Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se uporabi naslednja metodologija
za vse listinjene izvedene finančne instrumente se šteje, da imajo likviden trg

▼M4

Tabela 4.2

Listinjeni izvedeni finančni instrumenti – pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem

Razred sredstev – Listinjeni izvedeni finančni instrumenti		
Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem		
LIS, pred trgovanjem	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

▼B

5. **Obrestni izvedeni finančni instrumenti**

▼M3

Tabela 5.1

Obrestni izvedeni finančni instrumenti – razredi, ki nimajo likvidnega trga

Razred sredstev – Obrestni izvedeni finančni instrumenti				
vsaka pogodba, kot je opredeljena v oddelku C(4) Priloge I k Direktivi 2014/65/EU, pri kateri je končna osnova obrestna mera, obveznica, kredit, kakršna koli košarica, portfelj ali indeks, ki vključuje obrestno mero, obveznico, kredit, ali kateri koli drug produkt, ki se navezuje na obnašanje obrestne mere, obveznice, posojila.				
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno**		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
Standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na obveznice **/Standardizirana terminska pogodba na standardizirano terminsko pogodbo na obveznice**	podkategorija standardiziranih/nestandardiziranih terminskih pogodb na obveznice (*bond futures/forwards*) je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS2#17) – izdajatelj osnovnega instrumenta **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#18) – trajanje obveznice, ki je osnova in se izroči v okviru pogodbe, opredeljeno, kot sledi:	5 000 000 EUR	10	kadar koli se za podkategorijo določi, da ima likviden trg v zvezi s specifičnim žepkom zapadlosti (*maturity bucket*), in za podkategorijo, ki je opredeljena z naslednjim žepkom

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
/Nestandardizirana terminska pogodba na standardizirano terminsko pogodbo na obvezniceStandardizirana terminska pogodba na obveznico **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = BOND** **ali** **Nestandardizirana terminska pogodba na obveznico** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FORW** **RTS2#16 = BOND** **ali** **/Standardizirana terminska pogodba na standardizirano terminsko pogodbo na obveznice** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR**	**Kratkoročna**: izročljiva obveznica, ki je osnova, s trajanjem do 4 leta se šteje za kratkoročno **Srednjeročna**: izročljiva obveznica, ki je osnova, s trajanjem med 4 in 8 leti se šteje za srednjeročno **Dolgoročna**: izročljiva obveznica, ki je osnova, s trajanjem med 8 in 15 leti se šteje za dolgoročno **Ultra dolgoročna**: izročljiva obveznica, ki je osnova, s trajanjem več kot 15 let se šteje za ultra dolgoročno **Merilo za razčlenitev 3** – žepek zapadlosti standardizirane terminske pogodbe, opredeljen, kot sledi: Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 3 meseci Žepek zapadlosti 2: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev Žepek zapadlosti 3: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto Žepek zapadlosti 4: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti Žepek zapadlosti 5: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let			zapadlosti, da nima likvidnega trga, se za prvo terminsko pogodbo za najbolj oddaljeni mesec (*back month contract*) določi, da ima likviden trg, 2 tedna pred iztekom najbližjega meseca (*front month*).

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
RTS2#5 = FUTR **RTS2#16 = BNFD** **ali** **Nestandardizirana terminska pogodba na standardizirano terminsko pogodbo na obveznice** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FORW** **RTS2#16 = BNFD**				
Opcija na obveznice **/Opcija na opcijo na obveznice** **/Opcija na standardizirano terminsko pogodbo na obveznice** **Opcija na obveznice** **Opcija na opcijo na obveznice** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR**	podkategorija opcij na obveznico (*bond options*) je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS2#22) — končna obveznica, ki je osnova **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8) — žepek zapadlosti opcije, opredeljen, kot sledi: Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 3 meseci Žepek zapadlosti 2: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev Žepek zapadlosti 3: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto Žepek zapadlosti 4: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti Žepek zapadlosti 5: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	5 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
RTS2#5 = OPTN **RTS2#16 = BOND** **ali** **Opcija na opcijo na obveznice** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = BOND** **ali** **Opcija na standardizirano terminsko pogodbo na obveznice** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = BNFD**				

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
Obrestne terminske pogodbe in dogovori o terminski obrestni meri (FRA)/ Standardizirana terminska pogodba na obrestno terminsko pogodbo/ Dogovor o terminski obrestni meri na obrestno terminsko pogodbo **Obrestna terminska pogodba** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = INTR** **ali** **Dogovor o terminski obrestni meri** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FRAS** **RTS2#16 = INTR** **ali** **Standardizirana terminska pogodba na obrestno terminsko pogodbo**	podkategorija obrestnih terminskih pogodb (*IR futures*) je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS2#24) — obrestna mera, ki je osnova **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#25) — obdobje obrestne mere, ki je osnova **Merilo za razčlenitev 3** (RTS2#8) — žepek zapadlosti standardizirane terminske pogodbe, opredeljen, kot sledi: Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 3 meseci Žepek zapadlosti 2: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev Žepek zapadlosti 3: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto Žepek zapadlosti 4: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti Žepek zapadlosti 5: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	500 000 000 EUR	10	kadar koli se za podkategorijo določi, da ima likviden trg v zvezi s specifičnim žepkom zapadlosti (*maturity bucket*), in za podkategorijo, ki je opredeljena z naslednjim žepkom zapadlosti, da nima likvidnega trga, se za prvo terminsko pogodbo za najbolj oddaljeni mesec (*back month contract*) določi, da ima likviden trg, 2 tedna pred iztekom najbližjega meseca (*front month*).

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
RTS2#3 = DERV **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FUTR** **RTS2#16 = IFUT** **ali** **Dogovor o terminski obrestni meri na obrestno terminsko pogodbo** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = FRAS** **RTS2#16 = IFUT**				
Obrestne opcije **/Opcija na obrestno terminsko pogodbo/FRA** **/Opcija na obrestno opcijo**	podkategorija obrestnih opcij (*IR options*) je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS2#24) — obrestna mera, ki je osnova **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#25) — obdobje obrestne mere, ki je osnova **Merilo za razčlenitev 3** (RTS2#8) — žepek zapadlosti opcije, opredeljen, kot sledi: Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 3 meseci	500 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
/Opcija na opcijo na obrestno terminsko pogodbo/FRA **Opcija na obrestno terminsko pogodbo/FRA/Opcija na obrestno opcijo** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = IFUT** **ali** **Obrestna opcija/Opcija na opcijo na obrestno terminsko pogodbo/FRA** **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = OPTN** **RTS2#16 = INTR**	Žepek zapadlosti 2: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev Žepek zapadlosti 3: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto Žepek zapadlosti 4: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti Žepek zapadlosti 5: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let			

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
Opcije na zamenjavo **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** **RTS2#5 = SWPT**	podkategorija opcij na zamenjavo (*swaptions*) je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS2#16) — vrsta zamenjave, ki je osnova, opredeljena, kot sledi: zamenjava fiksne za fiksno obrestno mero v eni valuti (*fixed-to-fixed single currency swap*), standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave **[RTS2#16 = XXSC]** zamenjava fiksne za variabilno obrestno mero v eni valuti (*fixed-to-float single currency swap*), standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave **[RTS2#16 = XFSC]** zamenjava variabilne za variabilno obrestno mero v eni valuti (*float-to-float single currency swap*), standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave **[RTS2#16 = FFSC]** zamenjava inflacije v eni valuti (*inflation single currency swap*), standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave **[RTS2#16 = IFSC]** zamenjava na indeks transakcij čez noč v eni valuti (*OIS single currency swap*), standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave **[RTS2#16 = OSSC]** večvalutna zamenjava fiksne za fiksno obrestno mero (*fixed-to-fixed multi-currency swap*), standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave **[RTS2#16 = XXMC]**	500 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
	večvalutna zamenjava fiksne za variabilno obrestno mero (*fixed-to-float multi-currency swap*), standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave [**RTS2#16 = XFMC]**			
	večvalutna zamenjava variabilne za variabilno obrestno mero (*float-to-float multi-currency swap*), standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave [**RTS2#16 = FFMC]**			
	večvalutna zamenjava inflacije (*inflation multi-currency swap*), standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave [**RTS2#16 = IFMC]**			
	večvalutna zamenjava na indeks transakcij čez noč (*OIS multi-currency swap*), standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave [**RTS2#16 = OSMC]**			
	Merilo za razčlenitev 2 (RTS2#20) — nominalna valuta, ki je opredeljena kot valuta, v kateri je denominiran nominalni znesek opcije			
	Merilo za razčlenitev 3 (RTS2#22 ali RTS2#23) — indeks inflacije, če je vrsta zamenjave, ki je osnova, zamenjava inflacije v eni (*inflation single currency swap*) ali več valutah (*inflation multi-currency swap*)			
	Merilo za razčlenitev 4 (RTS2#21) — žepek zapadlosti zamenjave, opredeljen, kot sledi:			
	Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 mesec			
	Žepek zapadlosti 2: 1 mesec < čas do dospelosti ≤ 3 meseci			

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
	Žepek zapadlosti 3: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev Žepek zapadlosti 4: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto Žepek zapadlosti 5: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti Žepek zapadlosti 6: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let **Merilo za razčlenitev 5** (RTS2#8) — žepek zapadlosti opcije, opredeljen, kot sledi: **Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev **Žepek zapadlosti 2**: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto **Žepek zapadlosti 3**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti **Žepek zapadlosti 4**: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 5 let **Žepek zapadlosti 5**: 5 let < čas do dospelosti ≤ 10 let **Žepek zapadlosti 6**: več kot 10 let			

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
večvalutne (*fixed-to-float multi-currency swaps*) ali medvalutne zamenjave fiksne za variabilno obrestno mero (*fixed-to-float cross-currency swaps*) in standardizirane terminske pogodbe/nestandardizirane terminske pogodbe/opcije na te zamenjave zamenjava ali standardizirana terminska pogodba/nestandardizirana terminska pogodba/opcija na zamenjavo, pri kateri stranki zamenjata denarne tokove, denominirane v različnih valutah, pri čemer so denarni tokovi na eni strani zamenjave določeni s fiksno obrestno mero, denarni tokovi na drugi strani pa z variabilno obrestno mero **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP ali FONS ali FWOS ali OPTS RTS2#16 = XFMC	podkategorija večvalutnih zamenjav fiksne za variabilno obrestno mero je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#13 in RTS23#42) — par nominalnih valut, ki je opredeljen kot kombinacija dveh valut, v katerih sta denominirani strani zamenjave **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8) — žepek zapadlosti zamenjave, opredeljen, kot sledi: Žepek zapadlosti 1: 0 < dospelost ≤ 1 mesec Žepek zapadlosti 2: 1 mesec < dospelost ≤ 3 meseci Žepek zapadlosti 3: 3 meseci < dospelost ≤ 6 mesecev Žepek zapadlosti 4: 6 mesecev < dospelost ≤ 1 leto Žepek zapadlosti 5: 1 leto < dospelost ≤ 2 leti Žepek zapadlosti 6: 2 leti < dospelost ≤ 3 leta … Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
večvalutne (*float-to-float multi-currency swaps*) ali medvalutne zamenjave variabilne za variabilno obrestno mero (*float-to-float cross-currency swaps*) in standardizirane terminske pogodbe/nestandardizirane terminske pogodbe/opcije na te zamenjave zamenjava ali standardizirana terminska pogodba/nestandardizirana terminska pogodba/opcija na zamenjavo, pri kateri stranki zamenjata denarne tokove, denominirane v različnih valutah, pri čemer so denarni tokovi na obeh straneh zamenjave določeni z variabilnimi obrestnimi merami RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP ali FONS ali FWOS ali OPTS RTS2#16 = FFMC	podkategorija večvalutnih zamenjav variabilne za variabilno obrestno mero je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#13 in RTS23#42) — par nominalnih valut, ki je opredeljen kot kombinacija dveh valut, v katerih sta denominirani strani zamenjave **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8) — žepek zapadlosti zamenjave, opredeljen, kot sledi: Žepek zapadlosti 1: 0 < dospelost ≤ 1 mesec Žepek zapadlosti 2: 1 mesec < dospelost ≤ 3 meseci Žepek zapadlosti 3: 3 meseci < dospelost ≤ 6 mesecev Žepek zapadlosti 4: 6 mesecev < dospelost ≤ 1 leto Žepek zapadlosti 5: 1 leto < dospelost ≤ 2 leti Žepek zapadlosti 6: 2 leti < dospelost ≤ 3 leta … Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
večvalutne (*fixed-to-fixed multi-currency swaps*) ali medvalutne zamenjave fiksne za fiksno obrestno mero (*fixed-to-fixed cross-currency swaps*) in standardizirane terminske pogodbe/nestandardizirane terminske pogodbe/opcije na te zamenjave zamenjava ali standardizirana terminska pogodba/nestandardizirana terminska pogodba/opcija na zamenjavo, pri kateri stranki zamenjata denarne tokove, denominirane v različnih valutah, pri čemer so denarni tokovi na obeh straneh zamenjave določeni s fiksnimi obrestnimi merami RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP ali FONS ali FWOS ali OPTS RTS2#16 = XXMC	podkategorija večvalutnih zamenjav fiksne za fiksno obrestno mero je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#13 in RTS23#42) — par nominalnih valut, ki je opredeljen kot kombinacija dveh valut, v katerih sta denominirani strani zamenjave **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8) — žepek zapadlosti zamenjave, opredeljen, kot sledi: Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 mesec Žepek zapadlosti 2: 1 mesec < čas do dospelosti ≤ 3 meseci Žepek zapadlosti 3: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev Žepek zapadlosti 4: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto Žepek zapadlosti 5: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti Žepek zapadlosti 6: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
večvalutne (*overnight index swap (OIS) multi-currency swaps*) ali medvalutne zamenjave na indeks transakcij čez noč (*OIS cross-currency swaps*) in standardizirane terminske pogodbe/nestandardizirane terminske pogodbe/opcije na te zamenjave zamenjava ali standardizirana terminska pogodba/nestandardizirana terminska pogodba/opcija na zamenjavo, pri kateri stranki zamenjata denarne tokove, denominirane v različnih valutah, pri čemer so denarni tokovi na vsaj eni strani zamenjave določeni z obrestno mero zamenjave na indeks transakcij čez noč (OIS) RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP ali FONS ali FWOS ali OPTS RTS2#16 = OSMC	podkategorija večvalutnih zamenjav na indeks transakcij čez noč (IOS) je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#13 in RTS23#42) — par nominalnih valut, ki je opredeljen kot kombinacija dveh valut, v katerih sta denominirani strani zamenjave **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8) — žepek zapadlosti zamenjave, opredeljen, kot sledi: Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 mesec Žepek zapadlosti 2: 1 mesec < čas do dospelosti ≤ 3 meseci Žepek zapadlosti 3: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev Žepek zapadlosti 4: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto Žepek zapadlosti 5: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti Žepek zapadlosti 6: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
večvalutne (*inflation multi-currency swaps*) ali medvalutne zamenjave inflacije (*inflation cross-currency swaps*) in standardizirane terminske pogodbe/nestandardizirane terminske pogodbe/opcije na te zamenjave zamenjava ali standardizirana terminska pogodba/nestandardizirana terminska pogodba/opcija na zamenjavo, pri kateri stranki zamenjata denarne tokove, denominirane v različnih valutah, pri čemer so denarni tokovi na vsaj eni strani zamenjave določeni s stopnjo inflacije **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP ali FONS ali FWOS ali OPTS RTS2#16 = IFMC	podkategorija večvalutnih zamenjav inflacije je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#13 in RTS23#42) — par nominalnih valut, ki je opredeljen kot kombinacija dveh valut, v katerih sta denominirani strani zamenjave **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8) — žepek zapadlosti zamenjave, opredeljen, kot sledi: Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 mesec Žepek zapadlosti 2: 1 mesec < čas do dospelosti ≤ 3 meseci Žepek zapadlosti 3: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev Žepek zapadlosti 4: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto Žepek zapadlosti 5: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti Žepek zapadlosti 6: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
zamenjave fiksne za variabilno obrestno mero v eni valuti (*fixed-to-float single currency swaps*) in standardizirane terminske pogodbe/ nestandardizirane terminske pogodbe/opcije na te zamenjave zamenjava ali standardizirana terminska pogodba/nestandardizirana terminska pogodba/opcija na zamenjavo, pri kateri stranki zamenjata denarne tokove, denominirane v isti valuti, pri čemer so denarni tokovi na eni strani zamenjave določeni s fiksno obrestno mero, denarni tokovi na drugi strani pa z variabilno obrestno mero **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP ali FONS ali FWOS ali OPTS RTS2#16 = XFSC	podkategorija zamenjav fiksne za variabilno obrestno mero v eni valuti je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#13) — nominalna valuta, v kateri sta denominirani strani zamenjave **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8)— žepek zapadlosti zamenjave, opredeljen, kot sledi: Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 mesec Žepek zapadlosti 2: 1 mesec < čas do dospelosti ≤ 3 meseci Žepek zapadlosti 3: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev Žepek zapadlosti 4: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto Žepek zapadlosti 5: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti Žepek zapadlosti 6: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
Zamenjave variabilne za variabilno obrestno mero v eni valuti (*Float-to-Float single currency swaps*) in standardizirane terminske pogodbe/ nestandardizirane terminske pogodbe/opcije na te zamenjave zamenjava ali standardizirana terminska pogodba/nestandardizirana terminska pogodba/opcija na zamenjavo, pri kateri stranki zamenjata denarne tokove, denominirane v isti valuti, pri čemer so denarni tokovi na obeh straneh zamenjave določeni z variabilnimi obrestnimi merami RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP ali FONS ali FWOS ali OPTS RTS2#16 = FFSC	podkategorija zamenjav variabilne za variabilno obrestno mero v eni valuti je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#13) — nominalna valuta, v kateri sta denominirani strani zamenjave **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8) — žepek zapadlosti zamenjave, opredeljen, kot sledi: Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 mesec Žepek zapadlosti 2: 1 mesec < čas do dospelosti ≤ 3 meseci Žepek zapadlosti 3: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev Žepek zapadlosti 4: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto Žepek zapadlosti 5: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti Žepek zapadlosti 6: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
zamenjave fiksne za fiksno obrestno mero v eni valuti (*fixed-to-fixed single currency swaps*) in standardizirane terminske pogodbe/nestandardizirane terminske pogodbe/opcije na te zamenjave zamenjava ali standardizirana terminska pogodba/nestandardizirana terminska pogodba/opcija na zamenjavo, pri kateri stranki zamenjata denarne tokove, denominirane v isti valuti, pri čemer so denarni tokovi na obeh straneh zamenjave določeni s fiksnimi obrestnimi merami RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWAP ali FONS ali FWOS ali OPTS RTS2#16 = XXSC	podkategorija zamenjav fiksne za fiksno obrestno mero v eni valuti je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#13) — nominalna valuta, v kateri sta denominirani strani zamenjave **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8) — žepek zapadlosti zamenjave, opredeljen, kot sledi: Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 mesec Žepek zapadlosti 2: 1 mesec < čas do dospelosti ≤ 3 meseci Žepek zapadlosti 3: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev Žepek zapadlosti 4: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto Žepek zapadlosti 5: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti Žepek zapadlosti 6: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
Zamenjave na indeks transakcij čez noč v eni valuti (*Overnight Index Swap (OIS) single currency swaps*) in standardizirane terminske pogodbe/nestandardizirane terminske pogodbe/opcije na te zamenjave zamenjava ali standardizirana terminska pogodba/nestandardizirana terminska pogodba/opcija na zamenjavo, pri kateri stranki zamenjata denarne tokove, denominirane v isti valuti, pri čemer so denarni tokovi na vsaj eni strani zamenjave določeni z obrestno mero zamenjave na indeks transakcij čez noč (OIS) **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP ali FONS ali FWOS ali OPTS RTS2#16 = OSSC	podkategorija zamenjav na indeks transakcij čez noč (IOS) v eni valuti je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#13) — nominalna valuta, v kateri sta denominirani strani zamenjave **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8) — žepek zapadlosti zamenjave, opredeljen, kot sledi: Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 mesec Žepek zapadlosti 2: 1 mesec < čas do dospelosti ≤ 3 meseci Žepek zapadlosti 3: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev Žepek zapadlosti 4: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto Žepek zapadlosti 5: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti Žepek zapadlosti 6: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1), točka (b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Dodatno kvalitativno merilo za likvidnost**
Zamenjave inflacije v eni valuti (*inflation single currency swaps*) in standardizirane terminske pogodbe/ nestandardizirane terminske pogodbe/opcije na te zamenjave zamenjava ali standardizirana terminska pogodba/nestandardizirana terminska pogodba/opcija na zamenjavo, pri kateri stranki zamenjata denarne tokove, denominirane v isti valuti, pri čemer so denarni tokovi na vsaj eni strani zamenjave določeni s stopnjo inflacije **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = SWAP ali FONS ali FWOS ali OPTS RTS2#16 = IFSC	podkategorija zamenjav inflacije v eni valuti je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#13) — nominalna valuta, v kateri sta denominirani strani zamenjave **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8)— žepek zapadlosti zamenjave, opredeljen, kot sledi: Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 mesec Žepek zapadlosti 2: 1 mesec < čas do dospelosti ≤ 3 meseci Žepek zapadlosti 3: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev Žepek zapadlosti 4: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto Žepek zapadlosti 5: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti Žepek zapadlosti 6: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	50 000 000 EUR	10	

▼M3

Razred sredstev – Obrestni izvedeni finančni instrumenti	
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se uporabi naslednja metodologija**
Drugi obrestni izvedeni finančni instrumenti obrestni izvedeni finančni instrument, ki ne spada v nobenega od zgornjih podrazredov sredstev **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = INTR** RTS2#5 = OTHR	za vse druge obrestne izvedene finančne instrumente se šteje, da nimajo likvidnega trga

▼M4

Tabela 5.2

Obrestni izvedeni finančni instrumenti – Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanju in po njem za podkategorije, ki imajo likviden trg

Razred sredstev – Obrestni izvedeni finančni instrumenti									
Podrazred sredstev	**Percentili in spodnji pragovi, ki se morajo uporabiti za izračun pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za vsako podkategorijo, ki ima likviden trg**								
	Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov	**LIS, pred trgovanjem**		**SSTI, po trgovanju**			**LIS, po trgovanju**		
		Posli – percentil	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**
Standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na obveznice	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	5 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
Opcije na obveznico	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	5 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
Obrestne terminske pogodbe in dogovori o terminski obrestni meri (FRA)	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	10 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Obrestni izvedeni finančni instrumenti									
Podrazred sredstev	**Percentili in spodnji pragovi, ki se morajo uporabiti za izračun pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za vsako podkategorijo, ki ima likviden trg**								
	Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov	**LIS, pred trgovanjem**		**SSTI, po trgovanju**			**LIS, po trgovanju**		
		Posli – percentil	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**
Obrestne opcije	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	10 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
Opcije na zamenjavo	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Večvalutne (*Fixed-to-Float multi-currency swaps*) ali medvalutne zamenjave fiksne za variabilno obrestno mero (*Fixed-to-Float cross-currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Obrestni izvedeni finančni instrumenti									
Podrazred sredstev	**Percentili in spodnji pragovi, ki se morajo uporabiti za izračun pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za vsako podkategorijo, ki ima likviden trg**								
	Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov	**LIS, pred trgovanjem**		**SSTI, po trgovanju**			**LIS, po trgovanju**		
		Posli – percentil	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**
Večvalutne (*Float-to-Float multi-currency swaps*) ali medvalutne zamenjave variabilne za variabilno obrestno mero (*Float-to-Float cross-currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Večvalutne (*Fixed-to-Fixed multi-currency swaps*) ali medvalutne zamenjave fiksne za fiksno obrestno mero (*Fixed-to-Fixed cross-currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Obrestni izvedeni finančni instrumenti									
Podrazred sredstev	**Percentili in spodnji pragovi, ki se morajo uporabiti za izračun pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za vsako podkategorijo, ki ima likviden trg**								
	Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov	**LIS, pred trgovanjem**		**SSTI, po trgovanju**			**LIS, po trgovanju**		
		Posli – percentil	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**
Večvalutne (*Overnight Index Swap (OIS) multi-currency swaps*) ali medvalutne zamenjave na indeks transakcij čez noč (*OIS cross-currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Večvalutne (*Inflation multi-currency swaps*) ali medvalutne zamenjave inflacije (*Inflation cross-currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Zamenjave fiksne za variabilno obrestno mero v eni valuti (*Fixed-to-Float single currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Obrestni izvedeni finančni instrumenti									
Podrazred sredstev	**Percentili in spodnji pragovi, ki se morajo uporabiti za izračun pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za vsako podkategorijo, ki ima likviden trg**								
	Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov	**LIS, pred trgovanjem**		**SSTI, po trgovanju**			**LIS, po trgovanju**		
		Posli – percentil	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**
Zamenjave variabilne za variabilno obrestno mero v eni valuti (*Inflation single currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Zamenjave fiksne za fiksno obrestno mero v eni valuti (*Fixed-to-Fixed single currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Zamenjave na indeks transakcij čez noč v eni valuti (*Overnight Index Swap (OIS) single currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Obrestni izvedeni finančni instrumenti									
Podrazred sredstev	**Percentili in spodnji pragovi, ki se morajo uporabiti za izračun pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za vsako podkategorijo, ki ima likviden trg**								
	Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov	**LIS, pred trgovanjem**		**SSTI, po trgovanju**			**LIS, po trgovanju**		
		Posli – percentil	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**
Zamenjave inflacije v eni valuti (*Inflation single currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

Tabela 5.3

Obrestni izvedeni finančni instrumenti – Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki nimajo likvidnega trga

Razred sredstev – Obrestni izvedeni finančni instrumenti			
Podrazred sredstev	**Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za vsako podkategorijo, ki nima likvidnega trga**		
	LIS, pred trgovanjem	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
	Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na obveznice	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Opcije na obveznico	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Obrestne terminske pogodbe in dogovori o terminski obrestni meri (FRA)	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Obrestni izvedeni finančni instrumenti			
Podrazred sredstev	**Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za vsako podkategorijo, ki nima likvidnega trga**		
	LIS, pred trgovanjem	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
	Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Obrestne opcije	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Opcije na zamenjavo	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Večvalutne (*Fixed-to-Float multi-currency swaps*) ali medvalutne zamenjave fiksne za variabilno obrestno mero (*Fixed-to-Float cross-currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Večvalutne (*Float-to-Float multi-currency swaps*) ali medvalutne zamenjave variabilne za variabilno obrestno mero (*Float-to-Float cross-currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Večvalutne (*Fixed-to-Fixed multi-currency swaps*) ali medvalutne zamenjave fiksne za fiksno obrestno mero (*Fixed-to-Fixed cross-currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Večvalutne (*Overnight Index Swap (OIS) multi-currency swaps*) ali medvalutne zamenjave na indeks transakcij čez noč (*OIS cross-currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Večvalutne (*Inflation multi-currency swaps*) ali medvalutne zamenjave inflacije (*Inflation cross-currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Zamenjave fiksne za variabilno obrestno mero v eni valuti (*Fixed-to-Float single currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Obrestni izvedeni finančni instrumenti			
Podrazred sredstev	**Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za vsako podkategorijo, ki nima likvidnega trga**		
	LIS, pred trgovanjem	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
	Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Zamenjave variabilne za variabilno obrestno mero v eni valuti (*Inflation single currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Zamenjave fiksne za fiksno obrestno mero v eni valuti (*Fixed-to-Fixed single currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Zamenjave na indeks transakcij čez noč v eni valuti (*Overnight Index Swap (OIS) single currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Zamenjave inflacije v eni valuti (*Inflation single currency swaps*) in standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na te zamenjave	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Drugi obrestni izvedeni finančni instrumenti	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR

▼B

6. **Lastniški izvedeni finančni instrumenti**

▼M3

Tabela 6.1

Lastniški izvedeni finančni instrumenti – razredi, ki nimajo likvidnega trga

Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti
katera koli pogodba, kot je opredeljena v oddelku C(4) Priloge I k Direktivi 2014/65/EU, ki se nanaša na:
(a) eno ali več delnic, potrdil o lastništvu, investicijskih skladov, s katerimi se trguje na borzi, certifikatov, drugih podobnih finančnih instrumentov, denarnih tokov ali drugih produktov, povezanih z uspešnostjo ene ali več delnic, potrdil o lastništvu, investicijskih skladov, s katerimi se trguje na borzi, certifikatov ali drugih podobnih finančnih instrumentov;
(b) indeks delnic, potrdil o lastništvu, investicijskih skladov, s katerimi se trguje na borzi, certifikatov, drugih podobnih finančnih instrumentov, denarnih tokov ali drugih produktov, povezanih z uspešnostjo ene ali več delnic, potrdil o lastništvu, investicijskih skladov, s katerimi se trguje na borzi, certifikatov ali drugih podobnih finančnih instrumentov;

▼M3

Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti	
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se uporabi naslednja metodologija**
Opcije na delniške indekse opcije, pri katerih je osnova indeks, sestavljen iz delnic RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = STIX RTS23#26 ali, če je ničen, RTS23#28	za vse opcije na delniške indekse se šteje, da imajo likviden trg
Standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na delniške indekse standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe, pri katerih je osnova indeks, sestavljen iz delnic RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR ali FORW RTS2#27 = STIX RTS23#26 ali, če je ničen, RTS23#28	za vse standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na delniške indekse se šteje, da imajo likviden trg
Delniške opcije opcije, pri katerih je osnova delnica ali košarica delnic, ki izhajajo iz korporacijskega dejanja RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = SHRS RTS23#26 ali, če je ničen, RTS23#28	za vse delniške opcije se šteje, da imajo likviden trg

▼M3

Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti	
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se uporabi naslednja metodologija**
Standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na delnice standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe, pri katerih je osnova delnica ali košarica delnic, ki izhajajo iz korporacijskega dejanja RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR ali FORW RTS2#27 = SHRS RTS23#26 ali, če je ničen, RTS23#28	za vse standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na delnice se šteje, da imajo likviden trg
Opcije na dividende iz delnic opcije na dividende specifične delnice RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = DVSE RTS23#26 ali, če je ničen, RTS23#28	za vse opcije na dividende iz delnic se šteje, da imajo likviden trg
Standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na dividende iz delnic standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na dividende specifične delnice RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR ali FORW RTS2#27 = DVSE RTS23#26 ali, če je ničen, RTS23#28	za vse standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na dividende iz delnic se šteje, da imajo likviden trg

▼M3

Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti	
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se uporabi naslednja metodologija**
Opcije na indekse dividend opcije na indeks, sestavljen iz dividend več kot ene delnice RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = DIVI RTS23#26 ali, če je ničen, RTS23#28	za vse opcije na indekse dividend se šteje, da imajo likviden trg
Standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na indekse dividend standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na indeks, sestavljen iz dividend več kot ene delnice RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR ali FORW RTS2#27 = DIVI RTS23#26 ali, če je ničen, RTS23#28	za vse standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na indekse dividend se šteje, da imajo likviden trg
Opcije na indekse volatilnosti (*volatility index options*) opcije, pri katerih je osnova indeks volatilnosti, tj. indeks, ki se nanaša na volatilnost specifičnega osnovnega indeksa lastniških instrumentov RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = VOLI RTS23#26 ali, če je ničen, RTS23#28	za vse opcije na indekse volatilnosti se šteje, da imajo likviden trg

▼M3

Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti	
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se uporabi naslednja metodologija**
Standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na indekse volatilnosti standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe, pri katerih je osnova indeks volatilnosti, tj. indeks, ki se nanaša na volatilnost specifičnega osnovnega indeksa lastniških instrumentov RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR ali FORW RTS2#27 = VOLI RTS23#26 ali, če je ničen, RTS23#28	za vse standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na indekse volatilnosti se šteje, da imajo likviden trg
Opcije na investicijske sklade, s katerimi se trguje na borzi opcije, pri katerih je osnova investicijski sklad, s katerim se trguje na borzi RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = ETFS RTS23#26 ali, če je ničen, RTS23#28	za vse opcije na investicijske sklade, s katerimi se trguje na borzi, se šteje, da imajo likviden trg
Standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na investicijske sklade, s katerimi se trguje na borzi standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe, pri katerih je osnova investicijski sklad, s katerim se trguje na borzi RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR ali FORW RTS2#27 = ETFS RTS23#26 ali, če je ničen, RTS23#28	za vse standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na investicijske sklade, s katerimi se trguje na borzi, se šteje, da imajo likviden trg

▼M3

<table>
<tr><th colspan="5">Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Podrazred sredstev</th><th colspan="3" rowspan="2">Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj</th><th colspan="2">Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost</th></tr>
<tr><th>Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]</th><th>Povprečno dnevno število poslov [kvantitativno merilo za likvidnost 2]</th></tr>
<tr><td>Zamenjave
RTS2#3 = DERV
RTS2#4 = EQUI
RTS2#5 = SWAP</td><td colspan="3">podkategorija zamenjav je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev:
Merilo za razčlenitev 1 (RTS2#27) — vrsta osnove: posamezna, indeks, košarica
Merilo za razčlenitev 2 (RTS23#26 ali, če je ničen, RTS23#28) — posamezno sredstvo, indeks, košarica, ki je osnova
Merilo za razčlenitev 3 (RTS2#28) — parameter: osnovni parameter uspešnosti na podlagi spremembe cene instrumenta (price return basic performance parameter), parameter donosa iz dividend (parameter return dividend), parameter variance donosa (parameter return variance), parameter volatilnosti donosa (parameter return volatility)
Merilo za razčlenitev 4 (RTS2#8) — žepek zapadlosti zamenjave, opredeljen, kot sledi:</td><td>50 000 000 EUR</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="3"><table>
<tr><td>Osnovni parameter uspešnosti na podlagi spremembe cene instrumenta</td><td>Parameter variance/volatilnosti donosa</td><td>Parameter donosa na podlagi dividend</td></tr>
<tr><td>Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 mesec</td><td>Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 3 meseci</td><td>Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 leto</td></tr>
<tr><td>Žepek zapadlosti 2: 1 mesec < čas do dospelosti ≤ 3 meseci</td><td>Žepek zapadlosti 2: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev</td><td>Žepek zapadlosti 2: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti</td></tr>
<tr><td>Žepek zapadlosti 3: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev</td><td>Žepek zapadlosti 3: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto</td><td>Žepek zapadlosti 3: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta</td></tr>
<tr><td>Žepek zapadlosti 4: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto</td><td>Žepek zapadlosti 4: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti</td><td>…</td></tr>
</table></td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti					
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**			**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost**	
				Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
	Žepek zapadlosti 5: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti	**Žepek zapadlosti 5**: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta	**Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let		
	Žepek zapadlosti 6: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta	…			
	…	**Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let			
	Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let				
Portfeljske zamenjave RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = PSWP	podkategorija portfeljskih zamenjav je opredeljena s posebno kombinacijo naslednjih meril: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS2#27) — vrsta osnove: posamezna, indeks, košarica **Merilo za razčlenitev 2** (RTS23#26 ali, če je ničen, RTS23#28) — posamezno sredstvo, indeks, košarica, ki je osnova **Merilo za razčlenitev 3** (RTS2#28) — parameter: osnovni parameter uspešnosti na podlagi spremembe cene instrumenta (*price return basic performance parameter*), parameter donosa iz dividend (*parameter return dividend*), parameter variance donosa (*parameter return variance*), parameter volatilnosti donosa (*parameter return volatility*) **Merilo za razčlenitev 4** (RTS2#8) — žepek zapadlosti portfeljske zamenjave, opredeljen, kot sledi: **Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 mesec **Žepek zapadlosti 2**: 1 mesec < čas do dospelosti ≤ 3 meseci **Žepek zapadlosti 3**: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev **Žepek zapadlosti 4**: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto **Žepek zapadlosti 5**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti **Žepek zapadlosti 6**: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … **Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let			50 000 000 EUR	15

▼M3

Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti	
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se uporabi naslednja metodologija**
Drugi lastniški izvedeni finančni instrumenti lastniški izvedeni finančni instrument, ki ne spada v nobenega od zgornjih podrazredov sredstev RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OTHR	za vse druge lastniške izvedene finančne instrumente se šteje, da nimajo likvidnega trga

▼M4

Tabela 6.2

Lastniški izvedeni finančni instrumenti – Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki imajo likviden trg

Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti						
Podrazred sredstev	**Za namene določanja pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov**	**Vrednosti pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem, določene za podkategorije, za katere se šteje, da imajo likviden trg, na podlagi intervala povprečnega dnevnega nominalnega zneska (ADNA), v katerega spada podkategorija**			
			Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA)	**LIS, pred trgovanjem**	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
				Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Opcije na delniške indekse	podkategorija opcij na delniške indekse je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** – delniški indeks, ki je osnova	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	< 100 mio. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mio. EUR ≤ ADNA < 200 mio. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mio. EUR ≤ ADNA < 600 mio. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 mio. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti						
Podrazred sredstev	**Za namene določanja pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov**	**Vrednosti pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem, določene za podkategorije, za katere se šteje, da imajo likviden trg, na podlagi intervala povprečnega dnevnega nominalnega zneska (ADNA), v katerega spada podkategorija**			
			Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA)	**LIS, pred trgovanjem**	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
				Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Standardizirane/ nestandardizirane terminske pogodbe na delniške indekse	podkategorija standardiziranih/nestandardiziranih terminskih pogodb na delniške indekse je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** – delniški indeks, ki je osnova	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	< 100 mio. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mio. EUR ≤ ADNA < 1 mrd. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mrd. EUR ≤ ADNA < 3 mrd. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mrd. EUR ≤ ADNA < 5 mrd. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 mrd. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Delniške opcije	podkategorija delniških opcij je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** – delnica, ki je osnova	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	< 5 mio. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mio. EUR ≤ ADNA < 10 mio. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mio. EUR ≤ ADNA < 20 mio. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mio. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti						
Podrazred sredstev	**Za namene določanja pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov**	**Vrednosti pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem, določene za podkategorije, za katere se šteje, da imajo likviden trg, na podlagi intervala povprečnega dnevnega nominalnega zneska (ADNA), v katerega spada podkategorija**			
			Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA)	**LIS, pred trgovanjem**	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
				Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Standardizirane/ nestandardizirane terminske pogodbe na delnice	podkategorija standardiziranih/nestandardiziranih terminskih pogodb na delnice je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** – delnica, ki je osnova	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	< 5 mio. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mio. EUR ≤ ADNA < 10 mio. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mio. EUR ≤ ADNA < 20 mio. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mio. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
Opcije na dividende iz delnic	podkategorija opcij na dividende iz delnic je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** – delnica, ki je osnova in daje pravico do dividende	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	< 5 mio. EUR ADNA	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR
			5 mio. EUR ≤ ADNA < 10 mio. EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR
			10 mio. EUR ≤ ADNA < 20 mio. EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mio. EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti						
Podrazred sredstev	**Za namene določanja pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov**	**Vrednosti pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem, določene za podkategorije, za katere se šteje, da imajo likviden trg, na podlagi intervala povprečnega dnevnega nominalnega zneska (ADNA), v katerega spada podkategorija**			
			Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA)	**LIS, pred trgovanjem**	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
				Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Standardizirane/ nestandardizirane terminske pogodbe na dividende iz delnic	podkategorija standardiziranih/nestandardiziranih terminskih pogodb na dividende iz delnic je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** – delnica, ki je osnova in daje pravico do dividende	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	< 5 mio. EUR ADNA	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR
			5 mio. EUR ≤ ADNA < 10 mio. EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR
			10 mio. EUR ≤ ADNA < 20 mio. EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mio. EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR
Opcije na indekse dividend	podkategorija opcij na indekse dividend je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** – indeks dividend, ki je osnova	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	< 100 mio. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mio. EUR ≤ ADNA < 200 mio. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mio. EUR ≤ ADNA < 600 mio. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 mio. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti						
Podrazred sredstev	**Za namene določanja pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov**	**Vrednosti pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem, določene za podkategorije, za katere se šteje, da imajo likviden trg, na podlagi intervala povprečnega dnevnega nominalnega zneska (ADNA), v katerega spada podkategorija**			
			Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA)	**LIS, pred trgovanjem**	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
				Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Standardizirane/ nestandardizirane terminske pogodbe na indekse dividend	podkategorija standardiziranih/nestandardiziranih terminskih pogodb na indekse dividend je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** – indeks dividend, ki je osnova	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	< 100 mio. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mio. EUR ≤ ADNA < 1 mrd. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mrd. EUR ≤ ADNA < 3 mrd. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mrd. EUR ≤ ADNA < 5 mrd. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 mrd. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Opcije na indekse volatilnosti (*volatility index options*)	podkategorija opcij na indekse volatilnosti je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** – indeks volatilnosti, ki je osnova	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	< 100 mio. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mio. EUR ≤ ADNA < 200 mio. EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mio. EUR ≤ ADNA < 600 mio. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 mio. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti						
Podrazred sredstev	**Za namene določanja pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov**	**Vrednosti pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem, določene za podkategorije, za katere se šteje, da imajo likviden trg, na podlagi intervala povprečnega dnevnega nominalnega zneska (ADNA), v katerega spada podkategorija**			
			Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA)	**LIS, pred trgovanjem**	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
				Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Standardizirane/ nestandardizirane terminske pogodbe na indekse volatilnosti	podkategorija standardiziranih/nestandardiziranih terminskih pogodb na indekse volatilnosti je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** – indeks volatilnosti, ki je osnova	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	< 100 mio. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mio. EUR ≤ ADNA < 1 mrd. EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mrd. EUR ≤ ADNA < 3 mrd. EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mrd. EUR ≤ ADNA < 5 mrd. EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 mrd. EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Opcije na investicijske sklade, s katerimi se trguje na borzi	podkategorija opcij na investicijske sklade, s katerimi se trguje na borzi (ETF), je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** – ETF, ki je osnova	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	< 5 mio. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mio. EUR ≤ ADNA < 10 mio. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mio. EUR ≤ ADNA < 20 mio. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mio. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti						
Podrazred sredstev	**Za namene določanja pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov**	**Vrednosti pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem, določene za podkategorije, za katere se šteje, da imajo likviden trg, na podlagi intervala povprečnega dnevnega nominalnega zneska (ADNA), v katerega spada podkategorija**			
			Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA)	**LIS, pred trgovanjem**	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
				Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Standardizirane/ nestandardizirane terminske pogodbe na investicijske sklade, s katerimi se trguje na borzi	podkategorija standardiziranih/nestandardiziranih terminskih pogodb na investicijske sklade, s katerimi se trguje na borzi (ETF), je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** – ETF, ki je osnova	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	< 5 mio. EUR ADNA	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mio. EUR ≤ ADNA < 10 mio. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mio. EUR ≤ ADNA < 20 mio. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mio. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
Zamenjave	podkategorija zamenjav je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** – vrsta osnove: posamezna, indeks, košarica **Merilo za razčlenitev 2** – posamezno sredstvo, indeks, košarica, ki je osnova **Merilo za razčlenitev 3** – parameter: osnovni parameter uspešnosti na podlagi spremembe cene instrumenta (*price return basic performance parameter*), parameter donosa iz dividend (*parameter return dividend*), parameter variance donosa (*parameter return variance*), parameter volatilnosti donosa (*parameter return volatility*) **Merilo za razčlenitev 4** – žepek zapadlosti zamenjave, opredeljen, kot sledi:	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	50 mio. EUR ≤ ADNA < 100 mio. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mio. EUR ≤ ADNA < 200 mio. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 200 mio. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti								
Podrazred sredstev	**Za namene določanja pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**			**Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov**	**Vrednosti pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem, določene za podkategorije, za katere se šteje, da imajo likviden trg, na podlagi intervala povprečnega dnevnega nominalnega zneska (ADNA), v katerega spada podkategorija**			
					Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA)	**LIS, pred trgovanjem**	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
						Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
	Osnovni parameter uspešnosti na podlagi spremembe cene instrumenta	Parameter variance/volatilnosti donosa	Parameter donosa na podlagi dividend					
	Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 mesec	**Žepek zapadlosti 1:** 0 < čas do dospelosti ≤ 3 meseci	**Žepek zapadlosti 1:** 0 < čas do dospelosti ≤ 1 leto					
	Žepek zapadlosti 2: 1 mesec < čas do dospelosti ≤ 3 meseci	**Žepek zapadlosti 2:** 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev	**Žepek zapadlosti 2:** 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti					
	Žepek zapadlosti 3: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev	**Žepek zapadlosti 3:** 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto	**Žepek zapadlosti 3:** 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta					
	Žepek zapadlosti 4: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto	**Žepek zapadlosti 4:** 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti	…					

▼M4

Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti								
Podrazred sredstev	**Za namene določanja pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**			**Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov**	**Vrednosti pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem, določene za podkategorije, za katere se šteje, da imajo likviden trg, na podlagi intervala povprečnega dnevnega nominalnega zneska (ADNA), v katerega spada podkategorija**			
					Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA)	**LIS, pred trgovanjem**	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
						Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
	Žepek zapadlosti 5: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti	**Žepek zapadlosti 5:** 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta	**Žepek zapadlosti m:** (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let					
	Žepek zapadlosti 6: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta	…						
	…	**Žepek zapadlosti m:** (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let						
	Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let							
Portfeljske zamenjave	podkategorija portfeljskih zamenjav je opredeljena s posebno kombinacijo naslednjih meril: **Merilo za razčlenitev 1** – vrsta osnove: posamezna, indeks, košarica **Merilo za razčlenitev 2** – posamezno sredstvo, indeks, košarica, ki je osnova **Merilo za razčlenitev 3** – parameter: osnovni parameter uspešnosti na podlagi spremembe cene instrumenta (*price return basic performance parameter*), parameter donosa iz dividend (*parameter return dividend*), parameter variance donosa (*parameter return variance*), parameter volatilnosti donosa (*parameter return volatility*) **Merilo za razčlenitev 4** – žepek zapadlosti portfeljske zamenjave, opredeljen, kot sledi:			pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	50 mio. EUR ≤ ADNA < 100 mio. EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
					100 mio. EUR ≤ ADNA < 200 mio. EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
					ADNA ≥ 200 mio. EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti						
Podrazred sredstev	**Za namene določanja pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov**	**Vrednosti pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem, določene za podkategorije, za katere se šteje, da imajo likviden trg, na podlagi intervala povprečnega dnevnega nominalnega zneska (ADNA), v katerega spada podkategorija**			
			Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA)	**LIS, pred trgovanjem**	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
				Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
	Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 mesec **Žepek zapadlosti 2:** 1 mesec < čas do dospelosti ≤ 3 meseci **Žepek zapadlosti 3:** 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev **Žepek zapadlosti 4:** 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto **Žepek zapadlosti 5:** 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti **Žepek zapadlosti 6:** 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … **Žepek zapadlosti m:** (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let					

Tabela 6.3

Lastniški izvedeni finančni instrumenti – Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki nimajo likvidnega trga

Razred sredstev – Lastniški izvedeni finančni instrumenti			
Podrazred sredstev	**Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki nimajo likvidnega trga**		
	LIS, pred trgovanjem	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
	Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Zamenjave	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR
Portfeljske zamenjave	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR
Drugi lastniški izvedeni finančni instrumenti	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR

▼B

7. **Izvedeni finančni instrumenti na blago**

▼M3

Tabela 7.1

Izvedeni finančni instrumenti na blago – razredi, ki nimajo likvidnega trga

<table>
<tr><th colspan="3">Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na blago</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Podrazred sredstev</th><th rowspan="2">Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj</th><th colspan="2">Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov</th></tr>
<tr><th>Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]</th><th>Povprečno dnevno število poslov [kvantitativno merilo za likvidnost 2]</th></tr>
<tr><td>Standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na kovine
RTS2#3 = „DERV“ in RTS2#4 = „COMM“ in RTS23#35 = „METL“ in [RTS2#5 = „FUTR“ ali „FORW“]</td><td>podkategorija standardiziranih/nestandardiziranih terminskih pogodb na kovine je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev:
Merilo za razčlenitev 1 (RTS23#36) — vrsta kovine: plemenita kovina, neplemenita kovina
Merilo za razčlenitev 2 (RTS23#37) — kovina, ki je osnova
Merilo za razčlenitev 3 (RTS2#15) — nominalna valuta, ki je opredeljena kot valuta, v kateri je denominiran nominalni znesek standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe
Merilo za razčlenitev 4 (RTS2#8) — žepek zapadlosti standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe, opredeljen, kot sledi:
<table>
<tr><th>Plemenite kovine</th><th>Neplemenite kovine</th></tr>
<tr><td>Žepek zapadlosti 1:
0 < čas do dospelosti ≤ 3 meseci</td><td>Žepek zapadlosti 1:
0 < čas do dospelosti ≤ 1 leto</td></tr>
<tr><td>Žepek zapadlosti 2:
3 meseci < čas do dospelosti ≤ 1 leto</td><td>Žepek zapadlosti 2:
1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti</td></tr>
<tr><td>Žepek zapadlosti 3:
1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti</td><td>Žepek zapadlosti 3:
2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta</td></tr>
</table></td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
</table>

▼M3

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na blago				
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**		**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov**	
			Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
	Žepek zapadlosti 4: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta	…		
	…	**Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let		
	Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let			
Opcije na kovine RTS2#3 = „DERV“ in RTS2#4 = „COMM“ in RTS23#35 = „METL“ in RTS2#5 = „OPTN“	podkategorija opcij na kovine je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#36) — vrsta kovine: plemenita kovina, neplemenita kovina **Merilo za razčlenitev 2** (RTS23#37) — kovina, ki je osnova **Merilo za razčlenitev 3** (RTS2#15) — nominalna valuta, ki je opredeljena kot valuta, v kateri je denominiran nominalni znesek opcije **Merilo za razčlenitev 4** (RTS2#8) — žepek zapadlosti opcije, opredeljen, kot sledi:		10 000 000 EUR	10
	Plemenite kovine	**Neplemenite kovine**		
	Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 3 meseci	**Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 leto		
	Žepek zapadlosti 2: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 1 leto	**Žepek zapadlosti 2**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti		

▼M3

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na blago				
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**		**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov**	
			Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
	Žepek zapadlosti 3: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti	**Žepek zapadlosti 3**: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta		
	Žepek zapadlosti 4: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta	…		
	…	**Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let		
	Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let			
Zamenjave kovin RTS2#3 = „DERV“ in RTS2#4 = „COMM“ in RTS23#35 = „METL“ in RTS2#5 = „SWAP“	podkategorija zamenjav kovin (*metal commodity swaps*) je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#36) — vrsta kovine: plemenita kovina, neplemenita kovina **Merilo za razčlenitev 2** (RTS23#37) — kovina, ki je osnova **Merilo za razčlenitev 3** (RTS2#15) — nominalna valuta, ki je opredeljena kot valuta, v kateri je denominiran nominalni znesek zamenjave **Merilo za razčlenitev 4** (RTS23#34) — način izročitve, ki je lahko denarna, fizična ali neobvezna **Merilo za razčlenitev 5** (RTS2#8) — žepek zapadlosti zamenjave, opredeljen, kot sledi:		10 000 000 EUR	10
	Plemenite kovine	**Neplemenite kovine**		
	Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 3 meseci	**Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 leto		

▼M3

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na blago				
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**		**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov**	
			Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
	Žepek zapadlosti 2: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 1 leto	**Žepek zapadlosti 2**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti		
	Žepek zapadlosti 3: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti	**Žepek zapadlosti 3**: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta		
	Žepek zapadlosti 4: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta	…		
	…	**Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let		
	Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let			
Standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na energetske proizvode RTS2#3 = „DERV“ in RTS2#4 = „COMM“ in RTS23#35 = „NRGY“ in [RTS2#5 = „FUTR“ ali „FORW“]	podkategorija standardiziranih/nestandardiziranih terminskih pogodb na energetske proizvode je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#36) — vrsta energetskega proizvoda: nafta, destilati, premog, lahke frakcije, zemeljski plin, električna energija, kombinacija energetskih proizvodov **Merilo za razčlenitev 2** (RTS23#37) — energetski proizvod, ki je osnova **Merilo za razčlenitev 3** (RTS2#15) — nominalna valuta, ki je opredeljena kot valuta, v kateri je denominiran nominalni znesek standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe **Merilo za razčlenitev 4** — [črtano]		10 000 000 EUR	10

▼M3

<table>
<tr><td colspan="5">Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na blago</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Podrazred sredstev</td><td colspan="3" rowspan="2">Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj</td><td colspan="2">Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov</td></tr>
<tr><td>Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]</td><td>Povprečno dnevno število poslov [kvantitativno merilo za likvidnost 2]</td></tr>
<tr><td rowspan="8"></td><td colspan="3">Merilo za razčlenitev 5 (RTS2#14) — lokacija izročitve/denarne poravnave, ki se uporablja za vse vrste energetskih proizvodov
Merilo za razčlenitev 6 (RTS2#8) — žepek zapadlosti standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe, opredeljen, kot sledi:</td><td rowspan="8"></td><td rowspan="8"></td></tr>
<tr><td>Nafta/destilati/lahke frakcije</td><td>Premog</td><td>Zemeljski plin/električna energija/kombinacija energ. proizvodov</td></tr>
<tr><td>Žepek zapadlosti 1:
0 < čas do dospelosti ≤ 4 meseci</td><td>Žepek zapadlosti 1:
0 < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev</td><td>Žepek zapadlosti 1:
0 < čas do dospelosti ≤ 1 mesec</td></tr>
<tr><td>Žepek zapadlosti 2:
4 meseci < čas do dospelosti ≤ 8 mesecev</td><td>Žepek zapadlosti 2:
6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto</td><td>Žepek zapadlosti 2:
1 mesec < čas do dospelosti ≤ 1 leto</td></tr>
<tr><td>Žepek zapadlosti 3:
8 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto</td><td>Žepek zapadlosti 3:
1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti</td><td>Žepek zapadlosti 3:
1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti</td></tr>
<tr><td>Žepek zapadlosti 4:
1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti</td><td>…</td><td>…</td></tr>
<tr><td>…</td><td>Žepek zapadlosti m:
(n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let</td><td>Žepek zapadlosti m:
(n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let</td></tr>
<tr><td>Žepek zapadlosti m:
(n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let</td><td></td><td></td></tr>
</table>

▼M3

<table>
<tr><th colspan="4">Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na blago</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Podrazred sredstev</th><th rowspan="2">Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj</th><th colspan="2">Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov</th></tr>
<tr><th>Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]</th><th>Povprečno dnevno število poslov [kvantitativno merilo za likvidnost 2]</th></tr>
<tr><td>Opcije na energetske proizvode
RTS2#3 = „DERV“ in RTS2#4 = „COMM“ in RTS23#35 = „NRGY“ in RTS2#5 = „OPTN“</td><td>podkategorija opcij na energetske proizvode je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev:
Merilo za razčlenitev 1 (RTS23#36) — vrsta energetskega proizvoda: nafta, destilati, premog, lahke frakcije, zemeljski plin, električna energija, kombinacija energetskih proizvodov
Merilo za razčlenitev 2 (RTS23#37) — energetski proizvod, ki je osnova
Merilo za razčlenitev 3 (RTS2#15) — nominalna valuta, ki je opredeljena kot valuta, v kateri je denominiran nominalni znesek opcije
Merilo za razčlenitev 4 — [črtano]
Merilo za razčlenitev 5 (RTS2#14) — lokacija izročitve/denarne poravnave, ki se uporablja za vse vrste energetskih proizvodov
Merilo za razčlenitev 6 (RTS2#8) — žepek zapadlosti opcije, opredeljen, kot sledi:
<table>
<tr><th>Nafta/destilati/lahke frakcije</th><th>Premog</th><th>Zemeljski plin/električna energija/ kombinacija energ. proizvodov</th></tr>
<tr><td>Žepek zapadlosti 1:
0 < čas do dospelosti ≤ 4 meseci</td><td>Žepek zapadlosti 1:
0 < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev</td><td>Žepek zapadlosti 1:
0 < čas do dospelosti ≤ 1 mesec</td></tr>
<tr><td>Žepek zapadlosti 2:
4 meseci < čas do dospelosti ≤ 8 mesecev</td><td>Žepek zapadlosti 2:
6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto</td><td>Žepek zapadlosti 2:
1 mesec < čas do dospelosti ≤ 1 leto</td></tr>
</table>
</td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
</table>

▼M3

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na blago					
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**			**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov**	
				Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
	Žepek zapadlosti 3: 8 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto	**Žepek zapadlosti 3**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti	**Žepek zapadlosti 3**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti		
	Žepek zapadlosti 4: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti	…	…		
	…	**Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	**Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let		
	Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let				
Zamenjave energetskih proizvodov RTS2#3 = „DERV“ in RTS2#4 = „COMM“ in RTS23#35 = „NRGY“ in RTS2#5 = „SWAP“	podkategorija zamenjav energetskih proizvodov je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#36) — vrsta energetskega proizvoda: nafta, destilati, premog, lahke frakcije, zemeljski plin, električna energija, kombinacija energetskih proizvodov **Merilo za razčlenitev 2** (RTS23#37) — energetski proizvod, ki je osnova **Merilo za razčlenitev 3** (RTS2#15) — nominalna valuta, ki je opredeljena kot valuta, v kateri je denominiran nominalni znesek zamenjave **Merilo za razčlenitev 4** (RTS23#34) — način izročitve, ki je lahko denarna, fizična ali neobvezna **Merilo za razčlenitev 5** — [črtano] **Merilo za razčlenitev 6** (RTS2#14) — lokacija izročitve/denarne poravnave, ki se uporablja za vse vrste energetskih proizvodov **Merilo za razčlenitev 7** (RTS2#8) — žepek zapadlosti zamenjave, opredeljen, kot sledi:			10 000 000 EUR	10

▼M3

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na blago					
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**			**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov**	
				Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
	Nafta/destilati/lahke frakcije	**Premog**	**Zemeljski plin/električna energija/ kombinacija energ. proizvodov**		
	Žepek zapadlosti 1: 0 < čas do dospelosti ≤ 4 meseci	**Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev	**Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 mesec		
	Žepek zapadlosti 2: 4 meseci < čas do dospelosti ≤ 8 mesecev	**Žepek zapadlosti 2**: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto	**Žepek zapadlosti 2**: 1 mesec < čas do dospelosti ≤ 1 leto		
	Žepek zapadlosti 3: 8 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto	**Žepek zapadlosti 3**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti	**Žepek zapadlosti 3**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti		
	Žepek zapadlosti 4: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti	…	…		
	…	**Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	**Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let		
	Žepek zapadlosti m: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let				
Standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na kmetijske proizvode RTS2#3 = „DERV“ in RTS2#4 = „COMM“ in RTS23#35 = „AGRI“ in [RTS2#5 = „FUTR“ ali „FORW“]	podkategorija standardiziranih/nestandardiziranih terminskih pogodb na kmetijske proizvode je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#36 in RTS23#37) — kmetijski proizvod, ki je osnova (podvrsta produkta in nadaljnja podvrsta produkta) **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#15) — nominalna valuta, ki je opredeljena kot valuta, v kateri je denominiran nominalni znesek standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe			10 000 000 EUR	10

▼M3

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na blago			
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov**	
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
	Merilo za razčlenitev 3 (RTS2#8) — žepek zapadlosti standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe, opredeljen, kot sledi: **Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 3 meseci **Žepek zapadlosti 2**: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev **Žepek zapadlosti 3**: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto **Žepek zapadlosti 4**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti … **Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let		
Opcije na kmetijske proizvode RTS2#3 = „DERV“ in RTS2#4 = „COMM“ in RTS23#35 = „AGRI“ in RTS2#5 = „OPTN“	podkategorija opcij na kmetijske proizvode je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#36 in RTS23#37) — kmetijski proizvod, ki je osnova (podvrsta produkta in nadaljnja podvrsta produkta) **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#15) — nominalna valuta, ki je opredeljena kot valuta, v kateri je denominiran nominalni znesek opcije **Merilo za razčlenitev 3** (RTS2#8) — žepek zapadlosti opcije, opredeljen, kot sledi: **Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 3 meseci **Žepek zapadlosti 2**: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev **Žepek zapadlosti 3**: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto **Žepek zapadlosti 4**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti … **Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	10 000 000 EUR	10

▼M3

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na blago			
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov**	
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
Zamenjave kmetijskih proizvodov RTS2#3 = „DERV“ in RTS2#4 = „COMM“ in RTS23#35 = „AGRI“ in RTS2#5 = „SWAP“	podkategorija zamenjav kmetijskih proizvodov je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#36 in RTS23#37) — kmetijski proizvod, ki je osnova (podvrsta produkta in nadaljnja podvrsta produkta) **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#15) — nominalna valuta, ki je opredeljena kot valuta, v kateri je denominiran nominalni znesek zamenjave **Merilo za razčlenitev 3** (RTS23#34) — način izročitve, ki je lahko denarna, fizična ali neobvezna **Merilo za razčlenitev 4** (RTS2#8) — žepek zapadlosti zamenjave, opredeljen, kot sledi: **Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 3 meseci **Žepek zapadlosti 2**: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev **Žepek zapadlosti 3**: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto **Žepek zapadlosti 4**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti … **Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	10 000 000 EUR	10
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se uporabi naslednja metodologija**		
Drugi izvedeni finančni instrumenti na blago izvedeni finančni instrument na blago, ki ne spada v nobenega od zgornjih podrazredov sredstev	za vse druge izvedene finančne instrumente na blago se šteje, da nimajo likvidnega trga		

▼M4

Tabela 7.2

Izvedeni finančni instrumenti na blago – Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki imajo likviden trg

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na blago									
Podrazred sredstev	**Percentili in spodnji pragovi, ki se morajo uporabiti za izračun pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki imajo likviden trg**								
	Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov	**LIS, pred trgovanjem**		**SSTI, po trgovanju**			**LIS, po trgovanju**		
		Posli – percentil	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**
Standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na kovine	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Opcije na kovine	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Zamenjave kovin	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na blago									
Podrazred sredstev	**Percentili in spodnji pragovi, ki se morajo uporabiti za izračun pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki imajo likviden trg**								
	Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov	**LIS, pred trgovanjem**		**SSTI, po trgovanju**			**LIS, po trgovanju**		
		Posli – percentil	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**
Standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na energetske proizvode	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Opcije na energetske proizvode	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Zamenjave energetskih proizvodov	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na blago									
Podrazred sredstev	**Percentili in spodnji pragovi, ki se morajo uporabiti za izračun pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki imajo likviden trg**								
	Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov	**LIS, pred trgovanjem**		**SSTI, po trgovanju**			**LIS, po trgovanju**		
		Posli – percentil	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**
Standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na kmetijske proizvode	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Opcije na kmetijske proizvode	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Zamenjave kmetijskih proizvodov	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

▼M4

Tabela 7.3

Izvedeni finančni instrumenti na blago – Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki nimajo likvidnega trga

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na blago			
Podrazred sredstev	**Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki nimajo likvidnega trga**		
	LIS, pred trgovanjem	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
	Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na kovine	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Opcije na kovine	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Zamenjave kovin	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na energetske proizvode	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Opcije na energetske proizvode	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Zamenjave energetskih proizvodov	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na kmetijske proizvode	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Opcije na kmetijske proizvode	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Zamenjave kmetijskih proizvodov	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Drugi izvedeni finančni instrumenti na blago	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR

▼B

8. **Valutni izvedeni finančni instrumenti**

▼M3

Tabela 8.1

Valutni izvedeni finančni instrumenti – razredi, ki nimajo likvidnega trga

Razred sredstev – Valutni izvedeni finančni instrumenti			
finančni instrumenti, ki se nanašajo na valute, kot so opredeljeni v oddelku C(4) Priloge I k Direktivi 2014/65/EU			
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost**	
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
Nestandardizirane terminske pogodbe brez dejanske izročitve (*non-deliverable forwards*, NDF) to je nestandardizirana terminska pogodba, ki se v skladu s svojimi pogoji med nasprotnima strankama poravna v denarju, pri čemer se znesek poravnave določi na podlagi razlike v menjalnem tečaju med dvema valutama na datum trgovanja in na datum vrednotenja. Na datum poravnave bo ena stranka drugi stranki dolgovala neto razliko med (i) menjalnim tečajem, določenim na datum trgovanja, in (ii) menjalnim tečajem na datum vrednotenja na podlagi nominalnega zneska, pri čemer se ta neto znesek plača v valuti poravnave, ki je določena v pogodbi. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FORW RTS2#26 = NDLV	podkategorija valutnih nestandardiziranih terminskih pogodb brez dejanske izročitve je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#13 in RTS23#47) — par osnovnih valut, opredeljen kot kombinacija dveh valut, ki predstavljata osnovo za pogodbo o izvedenem finančnem instrumentu **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8) — žepek zapadlosti nestandardizirane terminske pogodbe, opredeljen, kot sledi: **Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 teden **Žepek zapadlosti 2**: 1 teden < čas do dospelosti ≤ 3 meseci **Žepek zapadlosti 3**: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 1 leto **Žepek zapadlosti 4**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti **Žepek zapadlosti 5**: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … **Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	za nestandardizirane terminske pogodbe brez dejanske izročitve (NDF) se šteje, da nimajo likvidnega trga	

▼M3

Razred sredstev – Valutni izvedeni finančni instrumenti			
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost**	
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
Nestandardizirane terminske pogodbe z dejansko izročitvijo (*deliverable forwards*, DF) to je nestandardizirana terminska pogodba, ki vključuje izključno zamenjavo dveh različnih valut na določen pogodbeni datum poravnave v prihodnosti po fiksnem tečaju, ki se dogovori ob sklenitvi pogodbe, ki se nanaša na zamenjavo RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FORW RTS2#26 = DLVB	podkategorija valutnih standardiziranih/nestandardiziranih terminskih pogodb z dejansko izročitvijo je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#13 in RTS23#47) — par osnovnih valut, opredeljen kot kombinacija dveh valut, ki predstavljata osnovo za pogodbo o izvedenem finančnem instrumentu **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8) — žepek zapadlosti nestandardizirane terminske pogodbe, opredeljen, kot sledi: **Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 teden **Žepek zapadlosti 2**: 1 teden < čas do dospelosti ≤ 3 meseci **Žepek zapadlosti 3**: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 1 leto **Žepek zapadlosti 4**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti **Žepek zapadlosti 5**: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … **Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	za nestandardizirane terminske pogodbe z dejansko izročitvijo (DF) se šteje, da nimajo likvidnega trga	

▼M3

Razred sredstev – Valutni izvedeni finančni instrumenti			
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost**	
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
Valutne opcije brez dejanske izročitve (*Non-Deliverable FX options*, NDO) to je opcija, ki se v skladu s svojimi pogoji med nasprotnima strankama poravna v denarju, pri čemer se znesek poravnave določi na podlagi razlike v menjalnem tečaju med dvema valutama na datum trgovanja in na datum vrednotenja Na datum poravnave bo ena stranka drugi stranki dolgovala neto razliko med (i) menjalnim tečajem, določenim na datum trgovanja, in (ii) menjalnim tečajem na datum vrednotenja na podlagi nominalnega zneska, pri čemer se ta neto znesek plača v valuti poravnave, ki je določena v pogodbi. RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = OPTN RTS2#26 = NDLV	podkategorija valutnih opcij brez dejanske izročitve je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#13 in RTS23#47) — par osnovnih valut, opredeljen kot kombinacija dveh valut, ki predstavljata osnovo za pogodbo o izvedenem finančnem instrumentu **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8) — žepek zapadlosti opcije, opredeljen, kot sledi: **Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 teden **Žepek zapadlosti 2**: 1 teden < čas do dospelosti ≤ 3 meseci **Žepek zapadlosti 3**: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 1 leto **Žepek zapadlosti 4**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti **Žepek zapadlosti 5**: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … **Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	za valutne opcije brez dejanske izročitve (NDO) se šteje, da nimajo likvidnega trga	

▼M3

Razred sredstev – Valutni izvedeni finančni instrumenti			
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost**	
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
Valutne opcije z dejansko izročitvijo (*Deliverable FX options*, DO) to je opcija, ki vključuje izključno zamenjavo dveh različnih valut na določen pogodbeni datum poravnave v prihodnosti po fiksnem tečaju, ki se dogovori ob sklenitvi pogodbe, ki se nanaša na zamenjavo **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = OPTN RTS2#26 = DLVB	podkategorija valutnih opcij z dejansko izročitvijo je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#13 in RTS23#47) — par osnovnih valut, opredeljen kot kombinacija dveh valut, ki predstavljata osnovo za pogodbo o izvedenem finančnem instrumentu **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8) — žepek zapadlosti opcije, opredeljen, kot sledi: **Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 teden **Žepek zapadlosti 2**: 1 teden < čas do dospelosti ≤ 3 meseci **Žepek zapadlosti 3**: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 1 leto **Žepek zapadlosti 4**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti **Žepek zapadlosti 5**: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … **Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	za valutne opcije z dejansko izročitvijo (DO) se šteje, da nimajo likvidnega trga	

▼M3

Razred sredstev – Valutni izvedeni finančni instrumenti			
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost**	
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
Valutne zamenjave brez dejanske izročitve (*Non-Deliverable FX swaps*, NDS) to je zamenjava, ki se v skladu s svojimi pogoji med nasprotnima strankama poravna v denarju, pri čemer se znesek poravnave določi na podlagi razlike v menjalnem tečaju med dvema valutama na datum trgovanja in na datum vrednotenja. Na datum poravnave bo ena stranka drugi stranki dolgovala neto razliko med (i) menjalnim tečajem, določenim na datum trgovanja, in (ii) menjalnim tečajem na datum vrednotenja na podlagi nominalnega zneska, pri čemer se ta neto znesek plača v valuti poravnave, ki je določena v pogodbi. **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = SWAP RTS2#26 = NDLV	podkategorija valutnih zamenjav brez dejanske izročitve je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#13 in RTS23#47) — par osnovnih valut, opredeljen kot kombinacija dveh valut, ki predstavljata osnovo za pogodbo o izvedenem finančnem instrumentu **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8) — žepek zapadlosti zamenjave, opredeljen, kot sledi: **Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 teden **Žepek zapadlosti 2**: 1 teden < čas do dospelosti ≤ 3 meseci **Žepek zapadlosti 3**: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 1 leto **Žepek zapadlosti 4**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti **Žepek zapadlosti 5**: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … **Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	za valutne zamenjave brez dejanske izročitve (NDS) se šteje, da nimajo likvidnega trga	

▼M3

Razred sredstev – Valutni izvedeni finančni instrumenti			
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost**	
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
Valutne zamenjave z dejansko izročitvijo (*Deliverable FX swaps*, DS) to je zamenjava, ki vključuje izključno zamenjavo dveh različnih valut na določen pogodbeni datum poravnave v prihodnosti po fiksnem tečaju, ki se dogovori ob sklenitvi pogodbe, ki se nanaša na zamenjavo **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = SWAP RTS2#26 = DLVB	podkategorija valutnih zamenjav z dejansko izročitvijo je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#13 in RTS23#47) — par osnovnih valut, opredeljen kot kombinacija dveh valut, ki predstavljata osnovo za pogodbo o izvedenem finančnem instrumentu **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8) — žepek zapadlosti zamenjave, opredeljen, kot sledi: **Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 teden **Žepek zapadlosti 2**: 1 teden < čas do dospelosti ≤ 3 meseci **Žepek zapadlosti 3**: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 1 leto **Žepek zapadlosti 4**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti **Žepek zapadlosti 5**: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … **Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	za valutne zamenjave z dejansko izročitvijo (DS) se šteje, da nimajo likvidnega trga	

▼M3

Razred sredstev – Valutni izvedeni finančni instrumenti			
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost**	
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
Standardizirane terminske pogodbe na valuto (*FX futures*) **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CURR** RTS2#5 = FUTR	podkategorija standardiziranih terminskih pogodb na valuto je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#13 in RTS23#47) — par osnovnih valut, opredeljen kot kombinacija dveh valut, ki predstavljata osnovo za pogodbo o izvedenem finančnem instrumentu **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8) —žepek zapadlosti standardizirane terminske pogodbe, opredeljen, kot sledi: **Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 teden **Žepek zapadlosti 2**: 1 teden < čas do dospelosti ≤ 3 meseci **Žepek zapadlosti 3**: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 1 leto **Žepek zapadlosti 4**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti **Žepek zapadlosti 5**: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … **Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	za standardizirane terminske pogodbe na valuto se šteje, da nimajo likvidnega trga	

Razred sredstev – Valutni izvedeni finančni instrumenti	
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se uporabi naslednja metodologija**
Drugi valutni izvedeni finančni instrumenti valutni izvedeni finančni instrument, ki ne spada v nobenega od zgornjih podrazredov sredstev RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = OTHR	za vse druge valutne izvedene finančne instrumente se šteje, da nimajo likvidnega trga

▼M4

Tabela 8.2

Valutni izvedeni finančni instrumenti – Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki nimajo likvidnega trga

Razred sredstev – Valutni izvedeni finančni instrumenti			
Podrazred sredstev	**Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki nimajo likvidnega trga**		
	LIS, pred trgovanjem	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
	Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Nestandardizirane terminske pogodbe brez dejanske poravnave (*non-deliverable forwards, NDF*)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Nestandardizirane terminske pogodbe z dejansko poravnavo (*deliverable forwards, DF*)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Valutne opcije brez dejanske poravnave (*Non-Deliverable FX options, NDO*)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Valutne opcije z dejansko poravnavo (*Deliverable FX options, DO*)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Valutne zamenjave brez dejanske poravnave (*Non-Deliverable FX swaps, NDS*)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Valutne zamenjave z dejansko poravnavo (*Deliverable FX swaps, DS*)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Standardizirane terminske pogodbe na valuto (*FX futures*)	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Drugi valutni izvedeni finančni instrumenti	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR

▼B

9. **Kreditni izvedeni finančni instrumenti**

▼M3

Tabela 9.1

Kreditni izvedeni finančni instrumenti – razredi, ki nimajo likvidnega trga

Razred sredstev – Kreditni izvedeni finančni instrumenti				
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno**		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Status aktualnosti indeksa (*On-the-run status*)** [dodatno kvalitativno merilo za likvidnost]
Indeks kreditnih zamenjav (*Index CDS*) zamenjava, pri kateri je izmenjava denarnih tokov povezana s kreditno sposobnostjo več izdajateljev finančnih instrumentov, ki sestavljajo indeks, in nastopom kreditnih dogodkov **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	podkategorija indeksov kreditnih zamenjav je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS2#34) — indeks, ki je osnova: **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#42) — nominalna valuta, ki je opredeljena kot valuta, v kateri je denominiran nominalni znesek izvedenega finančnega instrumenta **Merilo za razčlenitev 3** (RTS2#8) — žepek zapadlosti kreditne zamenjave (CDS), opredeljen, kot sledi: **Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 leto Žepek zapadlosti **2**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti Žepek zapadlosti **3**: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … **Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	200 000 000 EUR	10	za indeks, ki predstavlja osnovo, se šteje, da ima likviden trg: (1) v celotnem obdobju, ko ima status „najbolj aktualen“ (2) prvih 30 delovnih dni, ko ima status „prvi za najbolj aktualnim“ status „najbolj aktualen“ (*on-the-run*) pomeni, da je to najbolj aktualna zaporedna verzija (serija) indeksa, ki je ustvarjena na datum, na katerega postane veljavna sestava indeksa, in se konča en dan pred datumom, na katerega postane veljavna naslednja verzija (serija) indeksa. status „prvi za najbolj aktualnim“ (*1x off-the-run status*) pomeni verzijo (serijo) indeksa, ki je neposredno prva pred „najbolj aktualno“ verzijo (serijo) v določenem trenutku. Verzija (serija) preneha biti „najbolj aktualna“ in pridobi status „prve za najbolj aktualno“, ko je ustvarjena najnovejša verzija (serija) indeksa.

▼M3

Razred sredstev – Kreditni izvedeni finančni instrumenti				
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno**		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Status aktualnosti indeksa (*On-the-run status*)** [dodatno kvalitativno merilo za likvidnost]
Kreditna zamenjava za eno samo izpostavljenost (*Single name* CDS) zamenjava, pri kateri je izmenjava denarnih tokov povezana s kreditno sposobnostjo enega samega izdajatelja finančnih instrumentov in nastopom kreditnih dogodkov **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	podkategorija kreditnih zamenjav za eno samo izpostavljenost je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS2#41) — referenčni subjekt, ki je osnova **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#39) — vrsta referenčnega subjekta, ki je osnova, izmed naslednjih: „Izdajatelj državnega in javnega značaja“ pomeni izdajatelja, ki je eden izmed naslednjih subjektov: (a) Unija; (b) država članica, vključno z vladnim oddelkom, agencijo ali pravnim subjektom s posebnim namenom (*special purpose vehicle*) v državi članici; (c) suveren subjekt, ki ni naveden v točkah (a) in (b); (d) v primeru zvezne države članice ena od zveznih enot; (e) pravni subjekt s posebnim namenom za več držav članic; (f) mednarodna finančna institucija, ki sta jo ustanovili dve ali več držav članic in ima namen zagotoviti financiranje in finančno pomoč za svoje članice, ki imajo resne finančne težave ali jim te grozijo;	10 000 000 EUR	10	

▼M3

Razred sredstev – Kreditni izvedeni finančni instrumenti				
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno**		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Status aktualnosti indeksa (*On-the-run status*)** [dodatno kvalitativno merilo za likvidnost]
	(g) Evropska investicijska banka; (h) javni subjekt, ki ni državni izdajatelj, kot je navedeno v točkah (a) do (c). „Izdajatelj korporativnega značaja“ pomeni subjekt, ki ni izdajatelj državnega in javnega značaja. **Merilo za razčlenitev 3** (RTS2#42) — nominalna valuta, ki je opredeljena kot valuta, v kateri je denominiran nominalni znesek izvedenega finančnega instrumenta **Merilo za razčlenitev 4** (RTS2#8) — žepek zapadlosti kreditne zamenjave (CDS), opredeljen, kot sledi: **Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 leto Žepek zapadlosti **2**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti Žepek zapadlosti **3**: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … **Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let			
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne izpolnjuje naslednjega kvalitativnega merila za likvidnost**		
Opcije na indeks kreditnih zamenjav (CDS index options) opcije, pri katerih je osnova indeks kreditnih zamenjav	podkategorija opcij na indeks kreditnih zamenjav je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev:	za opcijo na indeks kreditnih zamenjav, pri kateri je osnovni indeks kreditnih zamenjav podkategorija z likvidnim trgom in z žepkom zapadlosti 0–6 mesecev, se šteje, da ima likviden trg		

▼M3

Razred sredstev – Kreditni izvedeni finančni instrumenti				
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno**		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Status aktualnosti indeksa (*On-the-run status*)** [dodatno kvalitativno merilo za likvidnost]
RTS2#3 = DERV **RTS2#4 = CRDT**	**Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#26) — podkategorija indeksa kreditnih zamenjav, kot je določena za podrazred sredstev „Indeks kreditnih zamenjav“ **Merilo za razčlenitev 2** (RTS2#8) — žepek zapadlosti opcije, opredeljen, kot sledi: **Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev Žepek zapadlosti **2**: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto Žepek zapadlosti **3**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti Žepek zapadlosti **4**: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … **Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	za opcijo na indeks kreditnih zamenjav, pri kateri je osnovni indeks kreditnih zamenjav podkategorija z likvidnim trgom, katere žepek zapadlosti ni 0–6 mesecev, se šteje, da nima likvidnega trga za opcijo na indeks kreditnih zamenjav, pri kateri je osnovni indeks kreditnih zamenjav podkategorija brez likvidnega trga, se šteje, da nima likvidnega trga za noben dani žepek zapadlosti		
Opcije na kreditne zamenjave za eno samo izpostavljenost opcije, pri katerih je osnova kreditna zamenjava za eno samo izpostavljenost **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT**	podkategorija opcij na kreditne zamenjave za eno samo izpostavljenost je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS23#26) — podkategorija kreditne zamenjave za eno samo izpostavljenost, kot je določena za podrazred sredstev „Kreditne zamenjave za eno samo izpostavljenost“	za opcijo na kreditno zamenjavo za eno samo izpostavljenost, pri kateri je osnovna kreditna zamenjava za eno samo izpostavljenost podkategorija z likvidnim trgom in z žepkom zapadlosti 0–6 mesecev, se šteje, da ima likviden trg za opcijo na kreditno zamenjavo za eno samo izpostavljenost, pri kateri je osnovna kreditna zamenjava za eno samo izpostavljenost podkategorija z likvidnim trgom, katere žepek zapadlosti ni 0–6 mesecev, se šteje, da nima likvidnega trga		

▼M3

Razred sredstev – Kreditni izvedeni finančni instrumenti				
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost. Za podkategorije, za katere je določeno, da imajo likviden trg, se uporabi dodatno kvalitativno merilo za likvidnost, kjer je relevantno**		
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]	**Status aktualnosti indeksa (*On-the-run status*)** [dodatno kvalitativno merilo za likvidnost]
	Merilo za razčlenitev 2 (RTS2#8) — žepek zapadlosti opcije, opredeljen, kot sledi: **Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev **Žepek zapadlosti 2**: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto **Žepek zapadlosti 3**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti Žepek zapadlosti **4**: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … **Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let	za opcijo na kreditno zamenjavo za eno samo izpostavljenost, pri kateri je osnovna kreditna zamenjava za eno samo izpostavljenost podkategorija brez likvidnega trga, se šteje, da nima likvidnega trga za noben dani žepek zapadlosti		

Razred sredstev – Kreditni izvedeni finančni instrumenti	
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se uporabi naslednja metodologija**
Drugi kreditni izvedeni finančni instrumenti kreditni izvedeni finančni instrument, ki ne spada v nobenega od zgornjih podrazredov sredstev **RTS2#3 = DERV** **RTS2#4 = CRDT** RTS2#5 = OTHR	za vse druge kreditne izvedene finančne instrumente se šteje, da nimajo likvidnega trga

▼M4

Tabela 9.2

Kreditni izvedeni finančni instrumenti – Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki imajo likviden trg

Razred sredstev – Kreditni izvedeni finančni instrumenti									
Podrazred sredstev	**Percentili in spodnji pragovi, ki se morajo uporabiti za izračun pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki imajo likviden trg**								
	Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov	**LIS, pred trgovanjem**		**SSTI, po trgovanju**			**LIS, po trgovanju**		
		Posli – percentil	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**
Indeks kreditnih zamenjav (*Index CDS*)	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Kreditna zamenjava za eno samo izpostavljenost (*Single name CDS*)	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
Opcije na indeks kreditnih zamenjav (*CDS index options*)	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Kreditni izvedeni finančni instrumenti									
Podrazred sredstev	**Percentili in spodnji pragovi, ki se morajo uporabiti za izračun pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki imajo likviden trg**								
	Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov	**LIS, pred trgovanjem**		**SSTI, po trgovanju**			**LIS, po trgovanju**		
		Posli – percentil	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**
Opcije na kreditne zamenjave za eno samo izpostavljenost	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR

Tabela 9.3

Kreditni izvedeni finančni instrumenti – Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki nimajo likvidnega trga

Razred sredstev – Kreditni izvedeni finančni instrumenti			
Podrazred sredstev	**Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki nimajo likvidnega trga**		
	LIS, pred trgovanjem	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
	Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Indeks kreditnih zamenjav (*Index CDS*)	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Kreditna zamenjava za eno samo izpostavljenost (*Single name CDS*)	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Opcije na indeks kreditnih zamenjav (*CDS index options*)	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Opcije na kreditne zamenjave za eno samo izpostavljenost	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Drugi kreditni izvedeni finančni instrumenti	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR

▼B

10. **Izvedeni finančni instrumenti C10**

▼M3

Tabela 10.1

Izvedeni finančni instrumenti C10 – razredi, ki nimajo likvidnega trga

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti C10			
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost**	
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
Izvedeni finančni instrumenti na prevozne stroške finančni instrumenti, ki se nanašajo na prevozne stroške, kot so opredeljeni v oddelku C(10) Priloge I k Direktivi 2014/65/EU RTS2#3 = „DERV“ in RTS2#4 = „COMM“ in RTS23#35 = „FRGT“	podkategorija izvedenih finančnih instrumentov na prevozne stroške je opredeljena z naslednjimi merili za razčlenitev: **Merilo za razčlenitev 1** (RTS2#5) — vrsta pogodbe: standardizirane terminske pogodbe ali opcije **Merilo za razčlenitev 2** (RTS23#36) — vrsta prevoza **Merilo za razčlenitev 3** (RTS2#37) — podvrsta prevoza **Merilo za razčlenitev 4** (RTS2#12) — navedba velikosti v zvezi s podvrsto prevoza **Merilo za razčlenitev 5** (RTS2#13) — specifična linija ali povprečje zakupa plovbe **Merilo za razčlenitev 6** (RTS2#8) — žepek zapadlosti izvedenega finančnega instrumenta, opredeljen, kot sledi: **Žepek zapadlosti 1**: 0 < čas do dospelosti ≤ 1 mesec **Žepek zapadlosti 2**: 1 mesec < čas do dospelosti ≤ 3 meseci **Žepek zapadlosti 3**: 3 meseci < čas do dospelosti ≤ 6 mesecev **Žepek zapadlosti 4**: 6 mesecev < čas do dospelosti ≤ 9 mesecev **Žepek zapadlosti 5**: 9 mesecev < čas do dospelosti ≤ 1 leto **Žepek zapadlosti 6**: 1 leto < čas do dospelosti ≤ 2 leti	10 000 000 EUR	10

▼M3

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti C10			
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost**	
		Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
	Žepek zapadlosti 7: 2 leti < čas do dospelosti ≤ 3 leta … **Žepek zapadlosti m**: (n–1) let < čas do dospelosti ≤ n let		

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti C10	
Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se uporabi naslednja metodologija**
Drugi izvedeni finančni instrumenti C10 finančni instrumenti, kot so opredeljeni v oddelku C(10) Priloge I k Direktivi 2014/65/EU, ki niso „izvedeni finančni instrumenti na prevozne stroške“, kateri koli od naslednjih podrazredov obrestnih izvedenih finančnih instrumentov: „večvalutne ali medvalutne zamenjave inflacije“, „standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na večvalutne ali medvalutne zamenjave inflacije“, „zamenjave inflacije v eni valuti“, „standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na zamenjave inflacije v eni valuti“ ter kateri koli od naslednjih podrazredov lastniških izvedenih finančnih instrumentov: „opcije na indekse volatilnosti“, „standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na indekse volatilnosti“, zamenjava s parametrom variance donosa, zamenjava s parametrom volatilnosti donosa, portfeljska zamenjava s parametrom variance donosa, portfeljska zamenjava s parametrom volatilnosti donosa	za vse druge izvedene finančne instrumente C10 se šteje, da nimajo likvidnega trga

▼M4

Tabela 10.2

Izvedeni finančni instrumenti C10 – Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki imajo likviden trg

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti C10									
Podrazred sredstev	**Percentili in spodnji pragovi, ki se morajo uporabiti za izračun pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki imajo likviden trg**								
	Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov	**LIS, pred trgovanjem**		**SSTI, po trgovanju**			**LIS, po trgovanju**		
		Posli – percentil	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**
Izvedeni finančni instrumenti na prevozne stroške	pragovi se morajo izračunati za vsako podkategorijo podrazreda sredstev ob upoštevanju poslov, izvršenih s finančnimi instrumenti, ki spadajo v podkategorijo	70	50 000 EUR	80	60	75 000 EUR	90	70	100 000 EUR

Tabela 10.3

Izvedeni finančni instrumenti C10 – Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki imajo likviden trg

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti C10			
Podrazred sredstev	**Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki nimajo likvidnega trga**		
	LIS, pred trgovanjem	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
	Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Izvedeni finančni instrumenti na prevozne stroške	50 000 EUR	75 000 EUR	100 000 EUR
Drugi izvedeni finančni instrumenti C10	50 000 EUR	75 000 EUR	100 000 EUR

▼B

11. **Finančne pogodbe na razliko (CFD)**

▼M3

Tabela 11.1

Finančne pogodbe na razliko – razredi, ki nimajo likvidnega trga

Podrazred sredstev	**Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj**	Kvalitativno merilo za likvidnost	**Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA)** [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
Valutne finančne pogodbe na razliko (*Currency CFD*) RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = CURR	podkategorija valutnih finančnih pogodb na razliko je opredeljena z osnovnim parom valut, tj. kombinacijo dveh valut, ki predstavlja osnovo za pogodbo na razliko/stavo na razmik (*spread bet*) RTS2#30 in RTS2#31		50 000 000 EUR	100
Blagovne finančne pogodbe na razliko (*Commodity CFD*) RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = COMM	podkategorija blagovnih finančnih pogodb na razliko je opredeljena z blagom, ki predstavlja osnovo za pogodbo na razliko/stavo na razmik RTS23#35 in RTS23#36 in RTS23#37		50 000 000 EUR	100
Finančne pogodbe na razliko za lastniške vrednostne papirje (*Equity CFD*) RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = EQUI	podkategorija finančnih pogodb na razliko za lastniške vrednostne papirje je opredeljena z lastniškim vrednostnim papirjem, ki predstavlja osnovo za pogodbo na razliko/stavo na razmik RTS23#26	za podkategorijo finančnih pogodb na razliko za lastniške vrednostne papirje se šteje, da ima likviden trg, če je osnova lastniški vrednostni papir, za katerega obstaja likviden trg, kot se določi v skladu s členom 2(1)(17)(b) Uredbe (EU) št. 600/2014		
Finančne pogodbe na razliko za obveznice (*Bond CFD*) RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = BOND	podkategorija finančnih pogodb na razliko za obveznice je opredeljena z obveznico ali standardizirano terminsko pogodbo na obveznico, ki predstavlja osnovo za pogodbo na razliko/stavo na razmik RTS23#26	za podkategorijo finančnih pogodb na razliko za obveznice se šteje, da ima likviden trg, če je osnova obveznica ali standardizirana terminska pogodba na obveznico, za katero obstaja likviden trg, kot se določi v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b).		

▼M3

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se vsak podrazred sredstev dodatno razčleni na podkategorije, kot so opredeljene spodaj	Kvalitativno merilo za likvidnost	Povprečen dnevni nominalni znesek (ADNA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	Povprečno dnevno število poslov [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
Finančne pogodbe na razliko za standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na lastniške vrednostne papirje (*CFDs on an equity future/forward*) RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = FTEQ	podkategorija finančnih pogodb na razliko za standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na lastniške vrednostne papirje je opredeljena s standardizirano/nestandardizirano terminsko pogodbo na lastniški vrednostni papir, ki predstavlja osnovo za pogodbo na razliko/stavo na razmik RTS23#26	za podkategorijo finančnih pogodb na razliko za standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na lastniške vrednostne papirje se šteje, da ima likviden trg, če je osnova standardizirana/nestandardizirana terminska pogodba na lastniške vrednostne papirje, za katero obstaja likviden trg, kot se določi v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b).		
Finančne pogodbe na razliko za opcije na lastniške vrednostne papirje (*CFDs on an equity option*) RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OPEQ	podkategorija finančnih pogodb na razliko za opcije na lastniške vrednostne papirje je opredeljena z opcijo na lastniški vrednostni papir, ki predstavlja osnovo za pogodbo na razliko/stavo na razmik RTS23#26	za podkategorijo finančnih pogodb na razliko za opcije na lastniške vrednostne papirje se šteje, da ima likviden trg, če je osnova opcija na lastniške vrednostne papirje, za katero obstaja likviden trg, kot se določi v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b)		

Razred sredstev – Finančne pogodbe na razliko

Podrazred sredstev	Za namene določanja razredov finančnih instrumentov, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da nimajo likvidnega trga, se uporabi naslednja metodologija
Druge finančne pogodbe na razliko	
pogodba na razliko/stava na razmik, ki ne spada v nobenega od zgornjih podrazredov sredstev RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OTHR	za vse druge pogodbe na razliko/stave na razmik se šteje, da nimajo likvidnega trga

▼M4

Tabela 11.2

Finančne pogodbe na razliko – Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki imajo likviden trg

Razred sredstev – Finančne pogodbe na razliko									
Podrazred sredstev	**Percentili in spodnji pragovi, ki se morajo uporabiti za izračun pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki imajo likviden trg**								
	Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov	**LIS, pred trgovanjem**		**SSTI, po trgovanju**			**LIS, po trgovanju**		
		Posli – percentil	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**
Valutne finančne pogodbe na razliko (*Currency CFD*)	posli, izvršeni z valutnimi finančnimi pogodbami na razliko, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da imajo likviden trg	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Blagovne finančne pogodbe na razliko (*Commodity CFD*)	posli, izvršeni z blagovnimi finančnimi pogodbami na razliko, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da imajo likviden trg	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Finančne pogodbe na razliko za lastniške vrednostne papirje (*Equity CFD*)	posli, izvršeni s finančnimi pogodbami na razliko za lastniške vrednostne papirje, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da imajo likviden trg	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Finančne pogodbe na razliko za obveznice (*Bond CFD*)	posli, izvršeni s finančnimi pogodbami na razliko za lastniške vrednostne papirje, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da imajo likviden trg	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Finančne pogodbe na razliko									
Podrazred sredstev	**Percentili in spodnji pragovi, ki se morajo uporabiti za izračun pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki imajo likviden trg**								
	Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov	**LIS, pred trgovanjem**		**SSTI, po trgovanju**			**LIS, po trgovanju**		
		Posli – percentil	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Obseg – percentil**	**Spodnji prag**
Finančne pogodbe na razliko za standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na lastniške vrednostne papirje (*CFDs on an equity future/forward*)	posli, izvršeni s finančnimi pogodbami na razliko za standardizirane terminske pogodbe na lastniške vrednostne papirje, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da imajo likviden trg	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
Finančne pogodbe na razliko za opcije na lastniške vrednostne papirje (*CFDs on an equity option*)	posli, izvršeni s finančnimi pogodbami na razliko za opcije na lastniške vrednostne papirje, za katere se v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b) šteje, da imajo likviden trg	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR

Tabela 11.3

Finančne pogodbe na razliko – Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki nimajo likvidnega trga

Razred sredstev – Finančne pogodbe na razliko			
Podrazred sredstev	**Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki nimajo likvidnega trga**		
	LIS, pred trgovanjem	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
	Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Valutne finančne pogodbe na razliko (*Currency CFD*)	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Blagovne finančne pogodbe na razliko (*Commodity CFD*)	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

▼M4

Razred sredstev – Finančne pogodbe na razliko			
Podrazred sredstev	**Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podkategorije, ki nimajo likvidnega trga**		
	LIS, pred trgovanjem	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
	Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Finančne pogodbe na razliko za lastniške vrednostne papirje (*Equity CFD*)	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Finančne pogodbe na razliko za obveznice (*Bond CFD*)	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Finančne pogodbe na razliko za standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na lastniške vrednostne papirje (*CFDs on an equity future/forward*)	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Finančne pogodbe na razliko za opcije na lastniške vrednostne papirje (*CFDs on an equity option*)	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Druge pogodbe na razliko/stave na razmik (*spread betting*)	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

12. **Pravice do emisije**

Tabela 12.1

Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije – razredi, ki nimajo likvidnega trga

Razred sredstev – Pravice do emisije	
Za namene določanja podrazredov sredstev, ki v skladu s členom 6a nimajo likvidnega trga, se uporabi naslednja metodologija:	
Podrazred sredstev	**Določitev likvidnosti**
Evropske pravice do emisije (EUA) katera koli enota, za katero je priznana skladnost z zahtevami Direktive 2003/87/ES Evropskega parlamenta in Sveta [1] (sistem trgovanja z emisijami), ki predstavlja pravico do izpusta ekvivalenta ene tone ekvivalenta ogljikovega dioksida (tCO_2e) RTS2#3 = EMAL in RTS23#37 = EUAE	za evropske pravice do emisije (EUA) se šteje, da imajo likviden trg
Vse druge pravice do emisije RTS2#3 = EMAL in RTS23#37 <> EUAE	za vse druge pravice do emisije se šteje, da nimajo likvidnega trga

[1] Direktiva 2003/87/ES evropskega parlamenta in Sveta z dne 13. oktobra 2003 o vzpostavitvi sistema za trgovanje s pravicami do emisije toplogrednih plinov v Skupnosti in o spremembi Direktive Sveta 96/61/ES (UL L 275, 25.10.2003, str. 32, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2003/87/oj).

▼M4

Tabela 12.2

Pravice do emisije – Prag za velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in prag za obseg po trgovanju

Razred sredstev – Pravice do emisije		
Podrazred sredstev	**LIS, pred trgovanjem**	**Prag za obseg po trgovanju**
Evropske pravice do emisije (EUA)	5 000 ton ekvivalenta ogljikovega dioksida	25 000 ton ekvivalenta ogljikovega dioksida
Vse druge pravice do emisije	Kateri koli obseg	Kateri koli obseg

▼B

13. **Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije**

▼M3

Tabela 13.1

Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije – razredi, ki nimajo likvidnega trga

	Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije	
Podrazred sredstev	**Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost**	
	Povprečen dnevni znesek (ADA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije, pri katerih je osnova evropska pravica do emisije (EUA) finančni instrument, ki se nanaša na pravice do emisije, ki so evropske pravice do emisije (EUA), kot je opredeljeno v oddelku C(4) Priloge I k Direktivi 2014/65/EU RTS2#3 = DERV in RTS2#4 = EMAL in RTS2#43 = EUAE	150 000 ton ekvivalenta ogljikovega dioksida	5

▼M3

Podrazred sredstev	Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije	
	Za posamezno podkategorijo se določi, da nima likvidnega trga v skladu s členom 6 in členom 8(1)(b), če ne dosega enega ali vseh naslednjih pragov kvantitativnih meril za likvidnost	
	Povprečen dnevni znesek (ADA) [kvantitativno merilo za likvidnost 1]	**Povprečno dnevno število poslov** [kvantitativno merilo za likvidnost 2]
Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije, pri katerih je osnova evropska pravica za letalstvo (EUAA) finančni instrument, ki se nanaša na pravice do emisije, ki so evropske pravice za letalstvo (EUAA), kot je opredeljeno v oddelku C(4) Priloge I k Direktivi 2014/65/EU RTS2#3 = DERV in RTS2#4 = EMAL in RTS2#43 = EUAA	150 000 ton ekvivalenta ogljikovega dioksida	5
Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije, pri katerih je osnova enota potrjenega zmanjšanja emisij (CER) finančni instrument, ki se nanaša na pravice do emisije, ki so enote potrjenega zmanjšanja emisij (CER), kot je opredeljeno v oddelku C(4) Priloge I k Direktivi 2014/65/EU RTS2#3 = DERV in RTS2#4 = EMAL in RTS2#43 = CERE	150 000 ton ekvivalenta ogljikovega dioksida	5
Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije, pri katerih je osnova enota zmanjšanja emisij (ERU) finančni instrument, ki se nanaša na pravice do emisije, ki so enote zmanjšanja emisij (ERU), kot je opredeljeno v oddelku C(4) Priloge I k Direktivi 2014/65/EU RTS2#3 = DERV in RTS2#4 = EMAL in RTS2#43 = ERUE	150 000 ton ekvivalenta ogljikovega dioksida	5
Drugi izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije izvedeni finančni instrument na pravice do emisije, katerega osnova je pravica do emisije, za katero je priznana skladnost z zahtevami Direktive 2003/87/ES (sistem za trgovanje z emisijami) in nievropska pravica do emisije (EUA), evropska pravica za letalstvo (EUAA), enota potrjenega zmanjšanja emisij (CER) in enota zmanjšanja emisij (ERU). RTS2#3 = DERV in RTS2#4 = EMAL in RTS2#43 = OTHR	za vse druge izvedene finančne instrumente na pravice do emisije se šteje, da nimajo likvidnega trga	

▼M4

Tabela 13.2

Izvedeni finančni instrument na pravice do emisije – Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podrazrede, ki imajo likviden trg

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije							
Podrazred sredstev	**Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov**	**Percentili in spodnji pragovi, ki se morajo uporabiti za izračun pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podrazrede sredstev, ki imajo likviden trg**					
		LIS, pred trgovanjem		**SSTI, po trgovanju**		**LIS, po trgovanju**	
		Posli – percentil	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Spodnji prag**
Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije, pri katerih je osnova evropska pravica do emisije (EUA)	posli, izvršeni z vsemi izvedenimi finančnimi instrumenti na pravice do emisije, pri katerih je osnova evropska pravica do emisije (EUA)	70	50 000 ton ogljikovega dioksida	80	90 000 ton ogljikovega dioksida	90	100 000 ton ogljikovega dioksida
Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije, pri katerih je osnova evropska pravica za letalstvo (EUAA)	posli, izvršeni z vsemi izvedenimi finančnimi instrumenti na pravice do emisije, pri katerih je osnova evropska pravica za letalstvo (EUAA)	70	25 000 ton ogljikovega dioksida	80	40 000 ton ogljikovega dioksida	90	50 000 ton ogljikovega dioksida
Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije, pri katerih je osnova enota potrjenega zmanjšanja emisij (CER)	posli, izvršeni z vsemi izvedenimi finančnimi instrumenti na pravice do emisije, pri katerih je osnova enota potrjenega zmanjšanja emisij (CER)	70	25 000 ton ogljikovega dioksida	80	40 000 ton ogljikovega dioksida	90	50 000 ton ogljikovega dioksida

▼M4

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije							
Podrazred sredstev	**Posli, ki se upoštevajo pri izračunu pragov**	**Percentili in spodnji pragovi, ki se morajo uporabiti za izračun pragov za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podrazrede sredstev, ki imajo likviden trg**					
		LIS, pred trgovanjem		**SSTI, po trgovanju**		**LIS, po trgovanju**	
		Posli – percentil	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Spodnji prag**	**Posli – percentil**	**Spodnji prag**
Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije, pri katerih je osnova enota zmanjšanja emisij (ERU)	posli, izvršeni z vsemi izvedenimi finančnimi instrumenti na pravice do emisije, pri katerih je osnova enota zmanjšanja emisij (ERU)	70	25 000 ton ogljikovega dioksida	80	40 000 ton ogljikovega dioksida	90	50 000 ton ogljikovega dioksida

Tabela 13.3

Izvedeni finančni instrument na pravice do emisije – Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podrazrede, ki nimajo likvidnega trga

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije			
Podrazred sredstev	**Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podrazrede sredstev, ki nimajo likvidnega trga**		
	LIS, pred trgovanjem	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
	Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije, pri katerih je osnova evropska pravica do emisije (EUA)	50 000 ton ogljikovega dioksida	90 000 ton ogljikovega dioksida	100 000 ton ogljikovega dioksida
Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije, pri katerih je osnova evropska pravica za letalstvo (EUAA)	25 000 ton ogljikovega dioksida	40 000 ton ogljikovega dioksida	50 000 ton ogljikovega dioksida

▼M4

Razred sredstev – Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije			
Podrazred sredstev	**Pragovi za opustitve in odloge za značilen obseg instrumenta (SSTI) in velike posle (LIS) pri preglednosti pred trgovanjem in po njem za podrazrede sredstev, ki nimajo likvidnega trga**		
	LIS, pred trgovanjem	**SSTI, po trgovanju**	**LIS, po trgovanju**
	Vrednost praga	**Vrednost praga**	**Vrednost praga**
Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije, pri katerih je osnova enota potrjenega zmanjšanja emisij (CER)	25 000 ton ogljikovega dioksida	40 000 ton ogljikovega dioksida	50 000 ton ogljikovega dioksida
Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije, pri katerih je osnova enota zmanjšanja emisij (ERU)	25 000 ton ogljikovega dioksida	40 000 ton ogljikovega dioksida	50 000 ton ogljikovega dioksida
Drugi izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije	25 000 ton ogljikovega dioksida	40 000 ton ogljikovega dioksida	50 000 ton ogljikovega dioksida

▼B

PRILOGA IV

Referenčni podatki, ki se morajo zagotoviti za namen izračunov v zvezi s preglednostjo

▼M3
▼C1

Tabela 1

Tabela z oblikami zapisa podatkov za tabelo 2

OBLIKA ZAPISA	VRSTA PODATKOV	OPREDELITEV
{ALPHANUM-n}	Do n alfanumeričnih znakov	Polje za prosto besedilo
{DECIMAL-n/m}	Decimalno število z do n števkami, od katerih je do m števk lahko decimalk	Numerično polje za pozitivne in negativne vrednosti: 1. decimalno ločilo je „.“ (pika); 2. pred številom je lahko predznak „–“ (minus) za označitev negativnih vrednosti. Kjer je ustrezno, se vrednosti zaokrožijo in se ne skrajšajo.
{COUNTRYCODE_2}	2 alfanumerična znaka	Dvočrkovna koda države v skladu s kodo države po ISO 3166-1 alfa-2
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerični znaki	Tričrkovna koda valute v skladu s kodo valute po ISO 4217
{DATEFORMAT}	Oblika datuma po ISO 8601	Datumi se poročajo v naslednji obliki: LLLL-MM-DD
{ISIN}	12 alfanumeričnih znakov	Koda ISIN, kot je opredeljena v standardu ISO 6166
{LEI}	20 alfanumeričnih znakov	Identifikator pravnih subjektov, kot je opredeljen v standardu ISO 17442
{MIC}	4 alfanumerični znaki	Identifikator trga, kot je opredeljen v standardu ISO 10383
{EIC}	16 alfanumeričnih znakov	Identifikacijska koda udeleženca na trgu z energijo (EIC), ki se nanaša na točko izročitve v Evropski uniji ali zunaj nje
{INDEX}	4 črkovni znaki	„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

OBLIKA ZAPISA	VRSTA PODATKOV	OPREDELITEV
		„CIBO“ – CIBOR „MOSP“ – MOSPRIM „NIBO“ – NIBOR „PRBO“ – PRIBOR „TLBO“ – TELBOR „WIBO“ – WIBOR „TREA“ – Treasury „SWAP“ – SWAP „FUSW“ – Future SWAP

▼M3

Tabela 2

Podrobnosti o referenčnih podatkih, ki se morajo zagotoviti za namen izračunov v zvezi s preglednostjo

Št.	POLJE	PODATKI, KI SE POROČAJO	OBLIKA ZAPISA PODATKOV ZA POROČANJE
1	Identifikacijska koda instrumenta	Koda, ki se uporablja za identifikacijo finančnega instrumenta	{ISIN}
2	Polni naziv instrumenta	Polni naziv finančnega instrumenta	{ALPHANUM-350}
3	Identifikator MiFIR	**Identifikacija nelastniških finančnih instrumentov:** **Listinjeni izvedeni finančni instrumenti**, kot so opredeljeni v tabeli 4.1 oddelka 4 Priloge III **Strukturirani finančni produkti (SFP)**, kot so opredeljeni v členu 2(1)(28) Uredbe (EU) št. 600/2014 **Obveznice (za vse obveznice razen ETC in ETN)**, kot so opredeljene v členu 4(1)(44)(b) Direktive 2014/65/EU **Instrumenti na blago, s katerimi se trguje na borzi (ETC)**, kot so opredeljeni v členu 4(1)(44)(b) Direktive 2014/65/EU in dodatno opisani v tabeli 2.4 oddelka 2 Priloge III **Zapisi, s katerimi se trguje na borzi (ETN)**, kot so opredeljeni v členu 4(1)(44)(b) Direktive 2014/65/EU in dodatno opisani v tabeli 2.4 oddelka 2 Priloge III **Pravice do emisije**, kot so opredeljene v tabeli 12.1 oddelka 12 Priloge III **Izvedeni finančni instrumenti**, kot so opredeljeni v oddelku C(4) do (10) Priloge I k Direktivi 2014/65/EU	**Nelastniški finančni instrumenti:** „SDRV“ – listinjeni izvedeni finančni instrumenti „SFPS“ – strukturirani finančni produkti (SFP) „BOND“ – obveznice „ETCS“ – instrumenti na blago, s katerimi se trguje na borzi (ETC) „ETNS“ – zapisi, s katerimi se trguje na borzi (ETN) „EMAL“ – pravice do emisije „DERV“ – izvedeni finančni instrumenti

▼M3

Št.	POLJE	PODATKI, KI SE POROČAJO	OBLIKA ZAPISA PODATKOV ZA POROČANJE
4	Razred sredstev, v katerega spada osnova	Polje se izpolni, če je identifikator MiFIR „Listinjen izvedeni finančni instrument“ ali „Izvedeni finančni instrument“.	„INTR“ – obrestna mera „EQUI“ – lastniški vrednostni papir „COMM“ – blago „CRDT“ – kredit „CURR“ – valuta „EMAL“ – pravice do emisije „OCTN“ – drugi izvedeni finančni instrumenti C10
5	Vrsta pogodbe	Polje se izpolni, če je identifikator MiFIR „Izvedeni finančni instrument“.	„OPTN“ – opcije „FUTR“ – standardizirane terminske pogodbe (vključno s terminskimi pogodbami na prevozne stroške (FFA)) „FRAS“ – dogovor o terminski obrestni meri (FRA) „FORW“ – nestandardizirane terminske pogodbe „SWAP“ – zamenjave „PSWP“ – portfeljske zamenjave „SWPT“ – opcije na zamenjavo „OPTS“ – opcija na zamenjavo „FONS“ – standardizirane terminske pogodbe na zamenjavo „FWOS“ – nestandardizirane terminske pogodbe na zamenjavo „SPDB“ – stave na razmik (*spread betting*) „CFDS“ – finančne pogodbe na razliko (CFD) „OTHR“ – drugo
6	Dan poročanja	Dan, za katerega se poročajo referenčni podatki.	{DATEFORMAT}
7	Mesto trgovanja	Koda MIC segmenta za mesto trgovanja, če je na voljo, sicer koda MIC upravljavca.	{MIC}
8	Dospelost	Določena dospelost finančnega instrumenta Polje se uporablja za naslednje razrede sredstev: obveznice, obrestne izvedene finančne instrumente, lastniške izvedene finančne instrumente, izvedene finančne instrumente na blago, valutne izvedene finančne instrumente, kreditne izvedene finančne instrumente, izvedene finančne instrumente C10 in izvedene finančne instrumente na pravice do emisije.	{DATEFORMAT}

Polja, povezana z obveznicami (vse vrste obveznic razen ETC in ETN)

Polja v tem oddelku se izpolnijo samo za obveznice, kot so opredeljene v tabeli 2.1 oddelka 2 Priloge III.

9	Vrsta obveznice	Vrsta obveznice, kot so navedene v tabeli 2.2 oddelka 2 Priloge III. Izpolni se samo, če je identifikator MiFIR „Obveznice“.	„EUSB“ – državna obveznica „OEPB“ – druga javna obveznica „CVTB“ – zamenljiva obveznica „CVDB“ – krita obveznica „CRPB“ – podjetniška obveznica „OTHR“ – drugo

▼M3

10	Datum izdaje	Datum, na katerega je obveznica izdana in se nanjo začnejo obračunavati obresti.	{DATEFORMAT}

Polja, povezana s pravicami do emisije

Polja v tem oddelku se izpolnijo samo za pravice do emisije, kot so opredeljene v tabeli 12.1 oddelka 12 Priloge III.

11	Podvrsta pravic do emisije	Pravice do emisije	„CERE“ – enota potrjenega zmanjšanja emisij (CER) „ERUE“ – enota zmanjšanja emisij (ERU) „EUAE“ – evropska pravica do emisije (EUA) „EUAA“ – evropska pravica za letalstvo (EUAA) „OTHR“ – drugo

Polja, povezana z izvedenimi finančnimi instrumenti

Izvedeni finančni instrumenti na blago in izvedeni finančni instrumenti C10

Polja v tem oddelku se izpolnijo samo za izvedene finančne instrumente na blago, kot so opredeljeni v tabeli 7.1 oddelka 7 Priloge III, in za izvedene finančne instrumente C10, kot so opredeljeni v tabeli 10.1 oddelka 10 Priloge III.

12	Navedba velikosti v zvezi s podvrsto prevoza	Polje se izpolni, če je osnovni produkt iz polja 35 v tabeli 2 Priloge k Delegirani uredbi (EU) 2017/585 prevoz.	Za prevoz suhega tovora: „CAPE“ — Capesize „PNMX“ – Panamax „SPMX“ – Supramax „HAND“ – Handysize Za prevoz mokrega tovora: „CLAN“ — čist „DRTY“ — umazan {ALPHANUM-4} za drugo
13	Specifična linija ali povprečje zakupa plovbe	Polje se izpolni, če je osnovni produkt iz polja 35 v tabeli 2 Priloge k Delegirani uredbi (EU) 2017/585 prevoz.	Za prevoz mokrega tovora: „TD7“ — TD7 „TD8“ — TD8 „TD17“ — TD17 „TD19“ — TD19 „TD20“ — TD20 „BLPG1“ — BLPG1 „TD3C“ — TD3C „TC2“ — TC2 „TC2_37“ — TC2_37 „TD3“ — TD3 „TC5“ — TC5 „TC6“ — TC6 „TC7“ — TC7 „TC9“ — TC9 „TC12“ — TC12 „TC14“ — TC14 „TC15“ — TC15

▼M3

			Za prevoz suhega tovora: „4TC“ — 4TC „5TC“ — 5TC „6TC“ — 6TC „10TC“ — 10TC „C3“ — C3 „C5“ — C5 „C7“ — C7 „P1A“ — P1A „P2A“ — P2A „P3A“ — P3A „P1E“ — P1E „P2E“ — P2E „P3E“— P3E {ALPHANUM-6} za drugo
14	Lokacija izročitve/ denarne poravnave	Polje se izpolni, če je osnovni produkt iz polja 35 v tabeli 2 Priloge k Delegirani uredbi (EU) 2017/585 energetski proizvod.	{EIC} za električno energijo ali zemeljski plin „OTHR“ – drugo
15	Nominalna valuta	Valuta, v kateri je denominirana nominalna vrednost.	{CURRENCYCODE_3}

Obrestni izvedeni finančni instrumenti

Polja v tem oddelku se izpolnijo samo za obrestne izvedene finančne instrumente, kot so opredeljeni v tabeli 5.1 oddelka 5 Priloge III.

16	Vrsta osnove	Izpolni se za vrste pogodb, ki niso zamenjave, opcije na zamenjavo, standardizirane terminske pogodbe in nestandardizirane terminske pogodbe na zamenjave z eno od naslednjih možnosti ********** Izpolni se za vrste pogodb, ki so zamenjave, opcije na zamenjavo, standardizirane terminske pogodbe in nestandardizirane terminske pogodbe na zamenjave v zvezi z osnovno zamenjavo z eno od naslednjih možnosti	„BOND“ – obveznica „BNDF“ – standardizirane terminske pogodbe na obveznice „INTR“ – obrestna mera „IFUT“ – obrestne terminske pogodbe ********** „FFMC“ – večvalutne zamenjave variabilne za variabilno obrestno mero „XFMC“ – večvalutne zamenjave fiksne za variabilno obrestno mero „XXMC“ – večvalutne zamenjave fiksne za fiksno obrestno mero „OSMC“ – večvalutne zamenjave na indeks transakcij čez noč „IFMC“ – večvalutne zamenjave inflacije „FFSC“ – zamenjave variabilne za variabilno obrestno mero v eni valuti „XFSC“ – zamenjave fiksne za variabilno obrestno mero v eni valuti

▼M3

			„XXSC“ – zamenjave fiksne za fiksno obrestno mero v eni valuti „OSSC“ – zamenjave na indeks transakcij čez noč v eni valuti „IFSC“ – zamenjave inflacije v eni valuti
17	Izdajatelj obveznice, ki je osnova	Izpolni se, če je osnova obveznica ali standardizirana terminska pogodba na obveznico, in sicer z identifikatorjem pravnih subjektov (LEI) neposredne ali končne obveznice, ki je osnova.	{LEI}
18	Datum dospelosti obveznice, ki je osnova	Izpolni se z datumom dospelosti obveznice, ki je osnova.	{DATEFORMAT}
19	Datum izdaje obveznice, ki je osnova	Izpolni se z datumom izdaje obveznice, ki je osnova.	{DATEFORMAT}
20	Nominalna valuta opcije na zamenjavo	Izpolni se samo za opcije na zamenjavo.	{CURRENCYCODE_3}
21	Dospelost opcije, ki je osnova	Polje se izpolni samo za opcije na zamenjavo, standardizirane terminske pogodbe na zamenjave in nestandardizirane terminske pogodbe na zamenjave.	{DATEFORMAT}
22	Koda ISIN indeksa inflacije/koda ISIN zamenjave, ki je osnova	V primeru opcij na zamenjavo, pri katerih je osnova ena od naslednjih vrst zamenjav: zamenjava inflacije v eni valuti, standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na zamenjave inflacije v eni valuti, večvalutna zamenjava inflacije, standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na večvalutne zamenjave; kadar koli ima indeks inflacije kodo ISIN, je treba v polje vnesti kodo ISIN za ta indeks ********** V primeru opcij na obveznice/opcij na opcijo na obveznice/opcij na standardizirano terminsko pogodbo na obveznice je treba v polje vpisati kodo ISIN končne obveznice, ki je osnova.	{ISIN} ********** {ISIN}

▼M3

23	Naziv indeksa inflacije	Vnese se standardizirani naziv indeksa v primeru opcij na zamenjavo, pri katerih je osnova ena od naslednjih vrst zamenjav: zamenjava inflacije v eni valuti, standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na zamenjave inflacije v eni valuti, večvalutna zamenjava inflacije, standardizirane/nestandardizirane terminske pogodbe na večvalutne zamenjave;	{ALPHANUM-25}
24	Referenčna obrestna mera	Naziv referenčne obrestne mere.	{INDEX} ali {ALPHANUM-25} – če referenčna obrestna mera ni vključena v seznam {INDEX}.
25	Obdobje obrestne mere, ki je osnova	V to polje se vnese obdobje obrestne mere, ki je osnova pogodbe. Obdobje trajanja se izrazi v dnevih, tednih, mesecih ali letih. Če je obdobje obrestne mere celo število, se v tem polju navede standardni izraz, ki se začne z največjo časovno enoto (leta) in pada.	{INTEGER-3}+„DAYS“ – dnevi {INTEGER-3}+„WEEK“ – tedni {INTEGER-3}+„MNTH“ – meseci {INTEGER-3}+„YEAR“ – leta

Valutni izvedeni finančni instrumenti

Polja v tem oddelku se izpolnijo samo za valutne izvedene finančne instrumente, kot so opredeljeni v tabeli 8.1 oddelka 8 Priloge III.

26	Podvrsta pogodbe	Polje se izpolni za potrebe razlikovanja med nestandardiziranimi terminskimi pogodbami, opcijami in zamenjavami z dejansko izročitvijo in brez nje, kot so opredeljene v tabeli 8.1 oddelka 8 Priloge III.	„DLVB“ — z dejansko izročitvijo „NDLV“ – brez dejanske izročitve

Lastniški izvedeni finančni instrumenti

Ta polja se izpolnijo samo za lastniške izvedene finančne instrumente, kot so opredeljeni v tabeli 6.1 oddelka 6 Priloge III.

27	Vrsta osnove	Izpolni se, če je identifikator MiFIR „Izvedeni finančni instrument“, vrsta sredstev osnove je „Lastniški vrednostni papir“, podrazred sredstev pa ni niti „Zamenjave“ niti „Portfeljske zamenjave“.	„STIX“ — delniški indeks „SHRS“ – delnica „DIVI“ — indeks dividend „DVSE“ — dividende iz delnic „BSKT“ – košarica delnic, ki izhajajo iz korporacijskega dejanja „ETFS“ – investicijski skladi, s katerimi se trguje na borzi „VOLI“ – indeks volatilnosti „OTHR“ – drugi (potrdila o lastništvu, certifikati in drugi finančni instrumenti, podobni lastniškim)

▼M3

		********** Izpolni se, če je identifikator MiFIR „Izvedeni finančni instrument“, vrsta sredstev osnove je „Lastniški vrednostni papir“, podrazred sredstev je „Zamenjave“ ali „Portfeljske zamenjave“, merilo za razčlenitev 2, kot je opredeljeno v tabeli 6.1 oddelka 6 Priloge III, pa je „Posamezno sredstvo“.	********** „SHRS“ – delnica „DVSE“ — dividende iz delnic „ETFS“ – investicijski skladi, s katerimi se trguje na borzi „OTHR“ – drugi (potrdila o lastništvu, certifikati in drugi finančni instrumenti, podobni lastniškim)
		********** Izpolni se, če je identifikator MiFIR „Izvedeni finančni instrument“, vrsta sredstev osnove je „Lastniški vrednostni papir“, podrazred sredstev je „Zamenjave“ ali „Portfeljske zamenjave“, merilo za razčlenitev 2, kot je opredeljeno v tabeli 6.1 oddelka 6 Priloge III, pa je „Indeks“.	********** „STIX“ — delniški indeks „DIVI“ — indeks dividend „VOLI“ – indeks volatilnosti „OTHR“ – drugo
		********** Izpolni se, če je identifikator MiFIR „Izvedeni finančni instrument“, vrsta sredstev osnove je „Lastniški vrednostni papir“, podrazred sredstev je „Zamenjave“ ali „Portfeljske zamenjave“, merilo za razčlenitev 2, kot je opredeljeno v tabeli 6.1 oddelka 6 Priloge III, pa je „Košarica“.	********** „BSKT“ – košarica
28	Parameter	Izpolni se, če je identifikator MiFIR „Izvedeni finančni instrument“, vrsta sredstev osnove je „Lastniški vrednostni papir“, podrazred sredstev pa je eden od naslednjih: „Zamenjave“, „Portfeljske zamenjave“.	„PRBP“ – Osnovni parameter uspešnosti na podlagi spremembe cene instrumenta (*Price return basic performance parameter*) „PRDV“ – Parameter donosa na podlagi dividend „PRVA“ – Parameter variance „PRVO“ – Parameter volatilnosti

Pogodbe na razliko (CFD)

Polja se izpolnijo samo, če je vrsta pogodbe „Pogodba na razliko (CFD)“ ali „Stava na razmik“.

29	Vrsta osnove	Izpolni se samo, če je identifikator MiFIR „Izvedeni finančni instrument“ in vrsta pogodbe „Pogodba na razliko (CFD)“ ali „Stava na razmik“.	„CURR“ – valuta „EQUI“ – lastniški vrednostni papir „BOND“ – obveznice „FTEQ“ – standardizirane terminske pogodbe na lastniške vrednostne papirje „OPEQ“ – opcije na lastniške vrednostne papirje „COMM“ – blago „EMAL“ – pravice do emisije „OTHR“ – drugo

▼M3

30	Nominalna valuta 1	Valuta 1 v valutnem paru, ki je osnova. To polje se uporabi, kadar je vrsta osnove „Valuta“.	{CURRENCYCODE_3}
31	Nominalna valuta 2	Valuta 2 v valutnem paru, ki je osnova. To polje se uporabi, kadar je vrsta osnove „Valuta“.	{CURRENCYCODE_3}

Kreditni izvedeni finančni instrumenti

Polja v tem oddelku se izpolnijo samo za kreditne izvedene finančne instrumente, kot so opredeljeni v tabeli 9.1 oddelka 9 Priloge III.

32	Koda ISIN kreditne zamenjave, ki je osnova	Izpolni se za izvedene finančne instrumente na kreditne zamenjave, pri čemer se navede koda ISIN zamenjave, ki je osnova.	{ISIN}
33	Koda indeksa, ki je osnova	Izpolni se za izvedene finančne instrumente na indekse kreditnih zamenjav, pri čemer se navede koda ISIN indeksa.	{ISIN}
34	Naziv indeksa, ki je osnova	Izpolni se za izvedene finančne instrumente na indekse kreditnih zamenjav, pri čemer se navede standardizirani naziv indeksa.	{ALPHANUM-25}
35	Serija	Številka serije v indeksu, če je relevantno. Izpolni se za indeks kreditnih zamenjav ali izvedeni finančni instrument na indeks kreditnih zamenjav, pri čemer se navede serija indeksa kreditnih zamenjav.	{DECIMAL-18/17}
36	Verzija	Nova verzija serije se izda, če pride do dogodka neplačila enega od sestavnih delov in je treba indeks ponovno uravnotežiti, da se upošteva novo število sestavnih delov v indeksu. Izpolni se za indeks kreditnih zamenjav ali izvedeni finančni instrument na indeks kreditnih zamenjav, pri čemer se navede verzija indeksa kreditnih zamenjav.	{DECIMAL-18/17}
37	Meseci prevalitve (*Roll months*)	Vsi meseci, v katerih se pričakuje prevalitev (*roll)*, kot je določil ponudnik indeksa za dano leto. Polje se ponovi za vsak mesec prevalitve. Izpolni se za indeks kreditnih zamenjav ali izvedeni finančni instrument na indeks kreditnih zamenjav.	„01“, „02“, „03“, „04“, „05“, „06“, „07“, „08“, „09“, „10“, „11“, „12“
38	Naslednji datum prevalitve (*Next roll date*)	Izpolni se za indeks kreditnih zamenjav ali izvedeni finančni instrument na indeks kreditnih zamenjav, pri čemer se vnese naslednji datum prevalitve indeksa, kot ga je določil ponudnik indeksa.	{DATEFORMAT}
39	Izdajatelj državnega in javnega značaja	Izpolni se, kadar je referenčni subjekt kreditne zamenjave z eno samo izpostavljenostjo ali izvedenega finančnega instrumenta na kreditno zamenjavo z eno samo izpostavljenostjo državni izdajatelj, kot je opredeljen v tabeli 9.1 oddelka 9 Priloge III.	„TRUE“ – referenčni subjekt je izdajatelj državnega in javnega značaja „FALSE“ – referenčni subjekt ni izdajatelj državnega in javnega značaja

▼M3

40	Referenčna obveznost	Izpolni se za izvedene finančne instrumente na kreditno zamenjavo z eno samo izpostavljenostjo, pri čemer se navede koda ISIN referenčne obveznosti.	{ISIN}
41	Referenčni subjekt	Navede se referenčni subjekt kreditne zamenjave z eno samo izpostavljenostjo ali izvedenega finančnega instrumenta na kreditno zamenjavo z eno samo izpostavljenostjo.	{COUNTRYCODE_2} ali 2-črkovna koda države po ISO 3166-2, ki ji sledi vezaj „-“ in do 3 alfanumerični znaki za podregijo države. ali {LEI}
42	Nominalna valuta	Valuta, v kateri je denominirana nominalna vrednost.	{CURRENCYCODE_3}

Izvedeni finančni instrumenti na pravice do emisije

Polja v tem oddelku se izpolnijo samo za izvedene finančne instrumente na pravice do emisije, kot so opredeljeni v tabeli 13.1 oddelka 13 Priloge III.

43	Podvrsta izvedenih finančnih instrumentov na pravice do emisije	Se izpolni, če je spremenljivka št. 3 „Identifikator MiFIR“ enaka „DERV“ (izvedeni finančni instrument) in spremenljivka št. 4 „Razred sredstev, v katerega spada osnova“ enaka „EMAL“ (pravice do emisije).	„CERE“ – enota potrjenega zmanjšanja emisij (CER) „ERUE“ – enota zmanjšanja emisij (ERU) „EUAE“ – evropska pravica do emisije (EUA) „EUAA“ – evropska pravica za letalstvo (EUAA) „OTHR“ – drugo

▼M3

PRILOGA V

Kvantitativni podatki, ki se morajo zagotoviti za namen izračunov v zvezi s preglednostjo

Tabela 1

Tabela z oblikami zapisa podatkov za tabelo 2

Oblika zapisa	Vrsta podatkov	Opredelitev
{ALPHANUM-n}	Do n alfanumeričnih znakov	Polje za prosto besedilo
{ISIN}	12 alfanumeričnih znakov	Koda ISIN, kot je opredeljena v standardu ISO 6166
{MIC}	4 alfanumerični znaki	Identifikator trga, kot je opredeljen v standardu ISO 10383
{DATEFORMAT}	Oblika datuma po ISO 8601	Datumi se poročajo v naslednji obliki: LLLL-MM-DD.
{DECIMAL-n/m}	Decimalno število s skupno do n števkami, od katerih je do m števk lahko decimalk.	Numerično polje za pozitivne in negativne vrednosti: Decimalno ločilo je „.“ (pika) negativne vrednosti imajo predznak „–“ (minus) vrednosti se zaokrožijo in se ne skrajšajo.
{INTEGER-n}	Celo število do n števk	Numerično polje za pozitivne in negativne cele vrednosti.

Tabela 2

Podrobnosti o podatkih, ki jih je treba zagotoviti za določitev likvidnega trga, pragov za velike posle in značilen obseg za nelastniške finančne instrumente

Št.	Polje	Podatki, ki se poročajo	Vrsta mesta izvršitve/ objave	Oblika zapisa podatkov in standardi za poročanje
1	Identifikacijska koda instrumenta	Koda, ki se uporablja za identifikacijo finančnega instrumenta	Regulirani trg (RM)) Večstranski sistem trgovanja (MTF) Organiziran sistem trgovanja (OTF) Sistem odobrenih objav (APA) Ponudnik stalnih informacij (CTP)	{ISIN}
2	Datum izvršitve	Datum, na katerega so posli izvršeni.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DATEFORMAT}

▼M3

Št.	Polje	Podatki, ki se poročajo	Vrsta mesta izvršitve/ objave	Oblika zapisa podatkov in standardi za poročanje
3	Mesto izvršitve	Koda MIC segmenta za mesto trgovanja v EU ali sistematičnega internalizatorja, če je na voljo, sicer koda MIC upravljavca. Koda MIC sistematičnega internalizatorja, če je na voljo, sicer koda MIC upravljavca. Koda MIC „XOFF“ za posle na prostem trgu. APA za dano kodo ISIN in datum izvršitve seštejejo vse dejavnosti trgovanja na prostem trgu za ta instrument v enem samem vnosu (ISIN, XOFF, datum izvršitve).	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{MIC} mesta trgovanja ali sistematičnega internalizatorja ali „XOFF“
4	Oznaka odloženega instrumenta	Kazalnik, ali je bilo trgovanje z instrumentom ves dan začasno ustavljeno na zadevnem mestu trgovanja na datum izvršitve Zato se polja 5 poročajo z vrednostjo nič.	RM, MTF, OTF	„TRUE“ – če je bilo trgovanje z instrumentom začasno ustavljeno za celoten trgovalni dan ali „FALSE“ – če trgovanje z instrumentom ni bilo začasno ustavljeno za celoten trgovalni dan
5	Skupno število poslov	Skupno število poslov, izvršenih na datum izvršitve. Posli, ki so bili preklicani, se izključijo iz sporočenih podatkov. Posli, za katere velja odlog objave, se štejejo v agregate, ki jih predložijo podjetja, ki sporočajo informacije, na podlagi datuma izvršitve. V vseh primerih je treba polje izpolniti z vrednostjo, ki je večja ali enaka nič. Pri instrumentih, s katerimi je trgovanje začasno ustavljeno za cel dan, ima polje vrednost nič.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
6	Skupni obseg	Skupni obseg, izvršen na datum izvršitve. Obseg se izmeri v skladu s tabelo 4 Priloge II k tej uredbi. Denarni zneski se poročajo v eurih. Posli, ki so bili preklicani, se izključijo iz sporočenih podatkov. Posli, za katere velja odlog objave, se štejejo v agregate, ki jih predložijo podjetja, ki sporočajo informacije, na podlagi datuma izvršitve.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

▼M3

Št.	Polje	Podatki, ki se poročajo	Vrsta mesta izvršitve/ objave	Oblika zapisa podatkov in standardi za poročanje
7	Razpon žepka „obseg posla“	To polje se izpolni z vrednostmi, kot so navedene v tabelah 3 in 4 te priloge. Velikost razpona žepka posla, kot je opredeljena: v tabeli 4 te priloge za pravice do emisije in njihove izvedene finančne instrumente; v tabeli 3 te priloge za druge instrumente. Za instrumente, s katerimi je trgovanje začasno ustavljeno za cel dan, se podatki, povezani s tem poljem ter polji 8 in 9, ne poročajo.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{ALPHANUM -140}
8	Skupno število poslov, izvršenih za ta žepek	Skupno število poslov, izvršenih na datum izvršitve, katerih velikost je v razponu žepkov. Posli, ki so bili preklicani, se izključijo iz sporočenih podatkov. Posli, za katere velja odlog objave, se štejejo v agregate, ki jih predložijo podjetja, ki sporočajo informacije, na podlagi datuma izvršitve.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
9	Skupni obseg, s katerim se trguje za navedeni žepek	Skupni obseg trgovanja, ki ga predstavljajo vsi posli, izvršeni na dan poročanja, katerih velikost je v razponu žepkov. Obseg se izmeri v skladu s tabelo 4 Priloge II k tej uredbi. Denarni zneski se poročajo v eurih. Posli, ki so bili preklicani, se izključijo iz sporočenih podatkov. Posli, za katere velja odlog objave, se štejejo v agregate, ki jih predložijo podjetja, ki sporočajo informacije, na podlagi datuma izvršitve.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

▼M3

Tabela 3

Žepki velikosti trgovanja z obveznicami, strukturiranimi finančnimi produkti, listinjenimi izvedenimi finančnimi instrumenti, obrestnimi izvedenimi finančnimi instrumenti, lastniškimi izvedenimi finančnimi instrumenti, valutnimi izvedenimi finančnimi instrumenti, kreditnimi izvedenimi finančnimi instrumenti, izvedenimi finančnimi instrumenti na blago, izvedenimi finančnimi instrumenti C10 in finančnimi pogodbami na razliko

Obseg	Velikost žepka posla	Opredelitev
Posli z velikostjo med 0 in 1,000,000 (izključeni)	]0 – 100,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja manjša od 100,000 EUR
	[100,000 – 100,000]	Posli, pri katerih je velikost trgovanja enaka 100,000 EUR
	]100,000 – 200,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja od 100,000 EUR in manjša od 200,000 EUR
	[200,000 – 300,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 200,000 EUR in manjša od 300,000 EUR
	[300,000 – 400,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 300,000 EUR in manjša od 400,000 EUR
	[Y – Y+100,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka Y EUR in manjša od Y EUR + 100,000 (100,000 EUR)
	[900,000 – 1,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 900,000 EUR in manjša od 1,000,000 EUR
Posli z velikostjo med 1,000,000 (vključeni) in 10,000,000 (izključeni)	[1,000,000 – 1,500,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 1,000,000 EUR in manjša od 1,500,000 EUR
	[1,500,000 – 2,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 1,500,000 EUR in manjša od 2,000,000 EUR
	[Z – Z+500,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka Z EUR in manjša od Z EUR + 500,000 (500,000 EUR)
	[9,500,000 – 10,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 9,500,000 EUR in manjša od 10,000,000 EUR
Posli z velikostjo med 10,000,000 (vključeni) in 100,000,000 (izključeni)	[10,000,000 – 15,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 10,000,000 EUR in manjša od 15,000,000 EUR
	[15,000,000 – 20,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 15,000,000 EUR in manjša od 20,000,000 EUR
	[W – W+5,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka W EUR in manjša od W EUR + 5,000,000 (5,000,000 EUR)
	[95,000,000 – 100,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 95,000,000 EUR in manjša od 100,000,000 EUR
Posli z velikostjo večjo ali enako 100,000,000	[100,000,000 – 125,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 100,000,000 EUR in manjša od 125,000,000 EUR
	[125,000,000 – 150,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 125,000,000 EUR in manjša od 150,000,000 EUR
	[X – X+25,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka X EUR in manjša od X EUR + 25,000,000 (25,000,000 EUR)
…	…	…

▼M3

Tabela 4

Velikost razponov žepkov poslov za pravice do emisije in izvedene finančne instrumente na pravice do emisije

Obseg	Velikost žepka posla	Opredelitev
Posli z velikostjo med 0 in 1,000,000 (izključeni)	]0 – 100,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja manjša od 100,000 ton ekvivalenta ogljikovega dioksida (tCO_2e)
	[100,000 – 100,000]	Posli, pri katerih je velikost trgovanja enaka 100,000 tCO_2e
	]100,000 – 200,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja od 100,000 tCO_2e in manjša od 200,000 tCO_2e
	[200,000 – 300,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 200,000 tCO_2e in manjša od 300,000 tCO_2e
	[300,000 – 400,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 300,000 tCO_2e in manjša od 400,000 tCO_2e
	[Y – Y+100,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka Y tCO_2e in manjša od Y tCO_2e +100,000 (100,000 tCO_2e)
	[900,000 – 1,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 900,000 tCO_2e in manjša od 1,000,000 tCO_2e
Posli z velikostjo med 1,000,000 (vključeni) in 10,000,000 (izključeni)	[1,000,000 – 1,500,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 1,000,000 tCO_2e in manjša od 1,500,000 tCO_2e
	[1,500,000 – 2,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 1,500,000 tCO_2e in manjša od 2,000,000 tCO_2e
	[Z – Z+500,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka Z tCO_2e + 500,000 (500,000 tCO_2e)
	[9,500,000 – 10,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 9,500,000 tCO_2e in manjša od 10,000,000 tCO_2e
Posli z velikostjo med 10,000,000 (vključeni) in 100,000,000 (izključeni)	[10,000,000 – 15,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 10,000,000 tCO_2e in manjša od 15,000,000 tCO_2e
	[15,000,000 – 20,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 15,000,000 tCO_2e in manjša od 20,000,000 tCO_2e
	[W – W+5,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka W tCO_2e in manjša od W tCO_2e +5,000,000 (5,000,000 tCO_2e)
	[95,000,000 – 100,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 95,000,000 tCO_2e in manjša od 100,000,000 tCO_2e
Posli z velikostjo večjo ali enako 100,000,000	[100,000,000 – 125,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 100,000,000 tCO_2e in manjša od 125,000,000 tCO_2e
	[125,000,000 – 150,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka 125,000,000 tCO_2e in manjša od 150,000,000 tCO_2e
	[X – X+25,000,000[	Posli, pri katerih je velikost trgovanja večja ali enaka X tCO_2e in manjša od X tCO_2e +25,000,000 (25,000,000 tCO_2e)
…	…	…