KOMISIJOS DELEGUOTASIS REGLAMENTAS (ES) 2017/583

2016 m. liepos 14 d.

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

(Tekstas svarbus EEE)

EUROPOS KOMISIJA,

atsižvelgdama į Sutartį dėl Europos Sąjungos veikimo,

atsižvelgdama į 2014 m. gegužės 15 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 600/2014 dėl finansinių priemonių rinkų, kuriuo iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 648/2012 ([1]), ypač į jo 1 straipsnio 8 dalį, 9 straipsnio 5 dalį, 11 straipsnio 4 dalį, 21 straipsnio 5 dalį ir 22 straipsnio 4 dalį,

kadangi:

(1) labai svarbu užtikrinti kuo didesnį skaidrumą, kad investuotojai būti tinkamai informuojami apie faktinių ir potencialių sandorių, susijusių su obligacijomis, struktūrizuotais finansiniais produktais, apyvartiniais taršos leidimais ir išvestinėmis finansinėmis priemonėmis, tikrąją apimtį, nepriklausomai nuo to, ar tie sandoriai vyksta reguliuojamose rinkose, daugiašalėse prekybos sistemose (DPS), organizuotos prekybos sistemose ar per sistemingai sandorius savo viduje sudarančius tarpininkus. Tokiu visišku skaidrumu taip pat turėtų būti sudarytos vienodos veiklos sąlygos prekybos vietoms, kad konkrečių finansinių priemonių kainos nustatymo proceso neapsunkintų likvidumo fragmentacija ir investuotojai dėl to neatsidurtų nepalankioje padėtyje;

(2) kartu būtina pripažinti, kad siekiant išvengti likvidumo sumažėjimo, kuris gali būti nenumatyta pareigų atskleisti sandorius ir taip paviešinti rizikos pozicijas pasekmė, tam tikrais atvejais reikėtų numatyti skaidrumo iki sandorio sudarymo reikalavimų taikymo išimtis ar skaidrumo po sandorio sudarymo reikalavimų taikymo atidėjimą. Todėl reikia patikslinti, kokiomis konkrečiomis aplinkybėmis gali būti leidžiama nesilaikyti skaidrumo iki sandorio sudarymo reikalavimų ir atidėti skaidrumo po sandorio sudarymo reikalavimų taikymą;

(3) šio reglamento nuostatos yra glaudžiai susijusios, nes jomis reglamentuojami skaidrumo iki sandorio ir po sandorio sudarymo reikalavimai, taikytini prekybai ne nuosavo kapitalo finansinėmis priemonėmis. Siekiant užtikrinti šių nuostatų, kurios įsigalios vienu metu, tarpusavio nuoseklumą ir palengvinti sąlygas visapusiškai jas apžvelgti suinteresuotiesiems subjektams, ypač tiems, kuriems taikomos šios pareigos, būtina šiuos techninius reguliavimo standartus pateikti viename reglamente;

(4) jei kompetentingos institucijos leidžia netaikyti skaidrumo iki sandorio sudarymo reikalavimų arba leidžia atidėti skaidrumo po sandorio sudarymo reikalavimų taikymą, jos turėtų visoms reguliuojamoms rinkoms, daugiašalėms prekybos sistemoms, organizuotos prekybos sistemoms ir investicinėms įmonėms, prekiaujančioms ne prekybos vietoje, nustatyti vienodas sąlygas ir jų nediskriminuoti;

(5) reikėtų patikslinti kelis techninius terminus. Šios techninės apibrėžtys būtinos tam, kad būtų užtikrintas vienodas šio reglamento nuostatų taikymas Sąjungoje ir taip būtų prisidedama prie bendro Sąjungos finansų rinkų taisyklių sąvado kūrimo. Vienintelė minėtų apibrėžčių paskirtis – nustatyti skaidrumo pareigas ne nuosavo kapitalo finansinių priemonių atžvilgiu, ir jomis turėtų būti vadovaujamasi vien siekiant suprasti šį reglamentą;

(6) biržinės prekės ir biržiniai vekseliai, kuriems taikytinas šis reglamentas, dėl jų teisinės struktūros laikytini skolos priemonėmis. Tačiau, kadangi jomis prekiaujama panašiai kaip biržiniais fondais, turėtų būti taikoma į biržinių fondų skaidrumo tvarką panaši tvarka;

([1]) OL L 173, 2014 6 12, p. 84.

(7) remiantis Reglamentu (ES) Nr. 600/2014, kai kurioms priemonėms gali būti leista netaikyti skaidrumo iki sandorio sudarymo reikalavimų, jei tokių priemonių rinka nėra likvidi. Šis reikalavimas turėtų būti taikomas ir išvestinėmis finansinėmis priemonėmis, kurioms taikytina tarpuskaitos pareiga, bet netaikoma prekybos pareiga, taip pat obligacijoms, išvestinėms finansinėms priemonėms, struktūrizuotiems finansiniams produktams ir apyvartiniams taršos leidimams, kurie nėra likvidūs;

(8) prekybos vieta, naudojanti prašymų dėl kotiruočių sistemą, turėtų skelbti tvirtas pirkimo ir pardavimo kainas ar informacinius pranešimus apie susidomėjimą bei nurodyti tų kainų intervalo apimtį ne vėliau kaip tuo momentu, kai prašymą pateikęs asmuo gali įvykdyti sandorį pagal sistemos taisykles. Tuo siekiama užtikrinti, kad nariai ar dalyviai, pirmi pateikiantys savo kotiruotes prašymą pateikusiam asmeniui, neatsidurtų nepalankioje padėtyje;

(9) dauguma likvidžių padengtų obligacijų yra hipotekos lakštai, išleisti privačių asmenų būsto paskoloms finansuoti, o jų vidutinė vertė tiesiogiai susijusi su paskolos verte. Padengtų obligacijų rinkoje likvidumą užtikrinantys subjektai užtikrina, kad profesionaliųjų investuotojų vykdomos stambaus masto prekybos apimtis atitiktų būstų savininkų vykdomos smulkaus masto prekybos apimtį. Siekiant išvengti šios funkcijos sutrikdymo ir nenumatytų neigiamų pasekmių būstų savininkams, priemonei būdingas dydis, kurį viršijus likvidumą užtikrinantys subjektai gali netaikyti skaidrumo iki sandorio sudarymo reikalavimų, turėtų būti lygus tokiam sandorio dydžiui, kurio nesiekia 40 proc. sandorių, nes toks sandorio dydis laikomas atitinkančiu vidutinę būsto kainą;

(10) kuo skubiau po realiojo laiko teiktina informacija turėtų būti paskelbta iš karto, kai tai techniškai įmanoma, darant prielaidą, kad rinkos operatorius, patvirtintas skelbimo subjektas (PSS) ar atitinkama investicinė įmonė veikia pakankamai produktyviai ir savo sistemoms skiria pakankamai lėšų. Informacija galėtų būti skelbiama per laikotarpį, beveik siekiantį ilgiausią nustatytą laikotarpį, tik išskirtiniais atvejais, kai dėl esamų sistemų nėra galimybių paskelbti informacijos greičiau;

(11) investicinės įmonės turėtų paskelbti informaciją apie sandorius, įvykdytus ne prekybos vietoje, per PSS. Šiuo reglamentu turėtų būti nustatytas būdas, kuriuo investicinės įmonės turėtų pranešti apie savo sandorius PSS, be to, šis reglamentas turėtų būti taikomas kartu su Komisijos deleguotuoju reglamentu (ES) 2017/571 ([1]);

(12) Reglamente (ES) Nr. 600/2014 nurodyta galimybė patikslinti, kaip taikoma pareiga po sandorio atskleisti duomenis apie dviejų investicinių įmonių, įskaitant sistemingai sandorius savo viduje sudarančius tarpininkus, įvykdytus sandorius, susijusius su obligacijomis, struktūrizuotais finansiniais produktais, apyvartiniais taršos leidimais ir išvestinėmis finansinėmis priemonėmis ir priklausančius ne nuo esamos rinkos vertės, o nuo kitų veiksnių, kaip antai finansinės priemonės įkeitimo. Tokie sandoriai neturi reikšmės kainos nustatymo procesui, neklaidina investuotojų ir nesudaro kliūčių optimaliam vykdymui, taigi šiame Reglamente nurodomi neskelbtini sandoriai, priklausantys ne nuo esamos rinkos vertės, o nuo kitų veiksnių;

(13) investicinės įmonės savo sąskaita arba klientų vardu dažnai vykdo išvestinių finansinių priemonių ir kitų finansinių priemonių ar turto sandorius, kuriuos sudaro keli tarpusavyje susiję ir vienas nuo kito priklausomi sandoriai. Tokiais sudėtiniais sandoriais investicinėms įmonėms ir jų klientams suteikiama galimybė geriau valdyti savo riziką, nes kiekviena sudėtinio sandorio dalis atspindi bendrą susijusių sandorių paketo rizikos pobūdį, o ne vyraujančią kiekvienos dalies rinkos kainą. Sudėtiniai sandoriai gali būti įvairaus pavidalo, pavyzdžiui, pakeitimas fiziniu turtu, prekybos vietose taikomos prekybos strategijos arba individualizuotas sudėtinis sandoris, ir į šiuos ypatumus svarbu atsižvelgti nustatant taikytiną skaidrumo tvarką. Todėl šiame reglamente tikslinga nurodyti sąlygas, kurioms esant skaidrumo po sandorio sudarymo reikalavimų taikymas sudėtiniams sandoriams atidedamas. Ši tvarka netaikytina įprastinėmis verslo sąlygomis vykdomiems sandoriams, kuriais apdraudžiamos finansinės priemonės;

(14) pakeitimas fiziniu turtu yra neatsiejama finansų rinkų dalis, sudaranti sąlygas rinkos dalyviams sudaryti ir įvykdyti biržinių išvestinių finansinių priemonių sandorius, tiesiogiai susietus su sandoriu pagrindinėje fizinėje rinkoje. Šia priemone plačiai naudojasi ir joje dalyvauja įvairiausi subjektai, kaip antai ūkininkai ir biržos prekių gamintojai bei perdirbėjai. Paprastai pakeitimo fiziniu turtu sandoris įvyksta tada, kai fizinio turto pardavėjas

([1]) 2016 m. birželio 2 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/571, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2014/65/ES papildoma techniniais reguliavimo standartais dėl duomenų teikimo paslaugų teikėjams taikytinų veiklos leidimo išdavimo, organizacinių ir skelbimo apie sandorius reikalavimų (žr. šio Oficieliojo leidinio p. 126).

siekia uždaryti savo atitinkamą apdraustą poziciją, susijusią su išvestinių finansinių priemonių sandoriu, sudarytu su fizinio turto pirkėju, kai pastarasis taip pat turi atitinkamą to paties išvestinių finansinių priemonių sandorio rizikos draudimą. Taigi tokiais sandoriais padedama sklandžiai uždaryti nebereikalingas apdraustas pozicijas;

(15) kalbant apie sandorius, įvykdytus ne pagal prekybos vietos taisykles, būtina paaiškinti, kuri investicinė įmonė turi paskelbti sandorį tais atvejais, kai abi sandorio šalys yra Sąjungoje įsisteigusios investicinės įmonės, kad būtų išvengta pasikartojančio sandorių skelbimo. Todėl pareiga paskelbti sandorį visada turėtų tekti parduodančiajai investicinei įmonei, išskyrus atvejus, kai tik viena iš sandorio šalių yra sistemingai sandorius savo viduje sudarantis tarpininkas ir tai yra perkančioji įmonė;

(16) tais atvejais, kai tik viena iš sandorio, susijusio su konkrečia finansine priemone, šalių yra sistemingai sandorius savo viduje sudarantis tarpininkas ir ji taip pat yra priemonę perkanti įmonė, ji turėtų būti atsakinga už sandorio paskelbimą, nes jos klientai to iš jos tikisi ir ji turi geresnes galimybes užpildyti pranešimo laukelį, nurodydama savo, kaip sistemingai sandorius savo viduje sudarančio tarpininko, statusą. Siekiant užtikrinti, kad sandoris būtų skelbiamas tik kartą, sistemingai sandorius savo viduje sudarantis tarpininkas turėtų kitą šalį informuoti, kad jis sandorį paskelbs;

(17) būtina ir toliau laikytis galiojančių standartų, taikytinų sandorių, vykdomų pagal kompensacinės prekybos susitarimus, skelbimui, kad tas pats sandoris nebūtų skelbiamas kaip keli sandoriai ir kad būtų teisiniu požiūriu aišku, kuri investicinė įmonė atsakinga už sandorio paskelbimą. Todėl du suderinti sandoriai, vienu metu ir už tą pačią kainą sudaryti su viena šalimi tarpininke, turėtų būti skelbiami kaip vienas sandoris;

(18) Reglamente (ES) Nr. 600/2014 kompetentingoms institucijoms leidžiama reikalauti, kad skelbiant informaciją, kurios skelbimas atidėtas, būtų paskelbti papildomi duomenys, arba leisti pratęsti atidėjimo laikotarpį. Siekiant padėti šias nuostatas vienodai taikyti visoje Sąjungoje, būtina nustatyti sąlygas bei kriterijus, kuriais remdamosi kompetentingos institucijos gali leisti papildomai atidėti informacijos skelbimą;

(19) prekyba daugeliu ne nuosavo kapitalo finansinių priemonių, visų pirma išvestinių finansinių priemonių, yra nereguliari, kintanti ir pasižyminti nuolat kintančiais prekybos modeliais. Todėl galutinai nustatyti finansines priemones, kurių rinka nėra likvidi, ir įvairias ribas, pagal kurias taikomos skaidrumo iki sandorio ir po sandorio sudarymo pareigos, nenumatant galimybės koreguoti likvidumo statusą ir ribas atsižvelgiant į prekybos modelių pokyčius, būtų netikslinga. Taigi reikėtų periodiškai nustatyti metodus ir parametrus, kuriais būtina remtis vertinant likvidumą ir apskaičiuojant ribas, kuriomis remiantis netaikomi skaidrumo iki sandorio sudarymo reikalavimai ir atidedamas skaidrumo po sandorio sudarymo reikalavimų taikymas;

(20) siekiant užtikrinti nuoseklią skaidrumo iki sandorio sudarymo reikalavimų netaikymo ir skaidrumo po sandorio sudarymo reikalavimų taikymo atidėjimo tvarką, būtina nustatyti vienodas taisykles, taikytinas duomenų, kurių skaidrumo tikslais kompetentingos institucijos gali pareikalauti iš prekybos vietų, PSS ir konsoliduotos informacinės juostos teikėjų (KIJT), turiniui ir teikimo periodiškumui. Be to, būtina nustatyti metodus atitinkamoms riboms apskaičiuoti ir parengti vienodas informacijos skelbimo visoje Sąjungoje taisykles. Taisyklės dėl konkrečių metodų ir duomenų, būtinų atliekant skaičiavimus, kuriais remiantis nustatoma ne nuosavo kapitalo finansinėmis priemonėmis taikytina skaidrumo tvarka, turėtų būti taikomos kartu su Komisijos deleguotuoju reglamentu (ES) 2017/577 ([1]), kuriuo bendresniais bruožais nustatomi prekybos vietoms, PSS ir KIJT skaidrumo ir kitų skaičiavimų tikslais teiktinų prašymų pateikti duomenis turinio ir formos bendrieji elementai;

(21) obligacijų, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas, atveju į mažesnės nei 100 000 EUR vertės sandorius neturėtų būti atsižvelgiama apskaičiuojant skaidrumo iki sandorio sudarymo ir skaidrumo po sandorio sudarymo ribas, nes tokie sandoriai laikytini mažmeninio dydžio. Tokiems mažmeniniams sandoriams visada turėtų būti taikoma nauja skaidrumo tvarka ir bet kokia nustatyta riba, kurią pasiekus suteikiama teisė netaikyti skaidrumo reikalavimų arba atidėti jų taikymą, turėtų būti didesnė už minėtą sumą;

(22) Reglamente (ES) Nr. 600/2014 numatyta skaidrumo pareigų taikymo išimtimi siekiama užtikrinti, kad informacijos apie tokius sandorius atskleidimas nepakenktų Eurosistemos operacijų veiksmingumui vykdant pagrindines užduotis, nustatytas Europos centrinių bankų sistemos ir Europos Centrinio Banko statute, pridėtame

([1]) 2016 m. birželio 13 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/577, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 dėl finansinių priemonių rinkų papildomas apimties viršutinės ribos mechanizmo ir informacijos teikimo skaidrumo ir kitų skaičiavimų tikslams techniniais reguliavimo standartais (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 174).

prie Europos Sąjungos Sutarties (toliau – Statutas), ir atitinkamose nacionalinėse nuostatose dėl Europos centrinių bankų sistemos (ECBS) narių valstybėse narėse, kurių valiuta nėra euro, kuris priklauso nuo laiku ir konfidencialiai vykdomų sandorių. Labai svarbu, kad centriniai bankai galėtų kontroliuoti, ar, kada ir kaip informacija apie jų veiksmus yra atskleidžiama, kad pageidaujamas poveikis būtų kuo didesnis, o nepageidaujamas poveikis rinkai būtų kuo mažesnis. Todėl ECBS nariams ir jų atitinkamoms sandorio šalims turėtų būti užtikrintas teisinis tikrumas dėl skaidrumo reikalavimų taikymo išimties taikymo srities;

(23) viena iš pagrindinių ECBS pareigų pagal Sutartį bei Statutą ir pagal atitinkamas nacionalines nuostatas dėl ECBS narių valstybėse narėse, kurių valiuta nėra euro, yra užsienio valiutos politikos įgyvendinimas, t. y. užsienio atsargų saugojimas ir valdymas siekiant užtikrinti, kad prireikus būtų pakankamai likvidžių išteklių jos užsienio valiutos politikos operacijoms. Taikant skaidrumo reikalavimus užsienio atsargų valdymo operacijoms, rinkoje gali atsirasti nepageidaujamų ženklų, galinčių sutrikdyti Eurosistemos ir ECBS narių valstybėse narėse, kurių valiuta nėra euro, vykdomą užsienio valiutos politiką. Panašios prielaidos kiekvienu konkrečiu atveju gali būti taikytinos ir užsienio atsargų valdymo operacijoms, vykdomoms įgyvendinant pinigų ir finansinio stabilumo politiką;

(24) skaidrumo pareigų taikymo išimtis, taikytina sandoriams, kurių sandorio šalis yra ECBS narys, neturėtų būti taikoma sandoriams, kuriuos ECBS narys sudarė, vykdydamas savo investicines operacijas. Tai turėtų būti taikoma ir operacijoms, vykdomoms administraciniais tikslais arba ECBS nario darbuotojų naudai, įskaitant sandorius, vykdomus einant pensijų sistemos administratoriaus pareigas pagal Statuto 24 straipsnį;

(25) laikinas skaidrumo pareigų taikymo sustabdymas turėtų būti taikomas tik ypatingais atvejais, smarkiai sumažėjus visos finansinių priemonių klasės likvidumui, remiantis objektyviais ir išmatuojamais kriterijais. Būtina atskirti klases, kurių rinka iš pradžių vertinta kaip likvidi, nuo tų, kurių rinka nebuvo likvidi, nes tolesnis žymus santykinis likvidumo sumažėjimas labiau tikėtinas klasėje, kurios rinka nebuvo laikoma likvidžia. Todėl skaidrumo reikalavimų taikymo sustabdymas priemonėms, kurių rinka nelaikoma likvidžia, turėtų būti taikomas tik tuo atveju, jei likvidumas sumažėjo iki aukštesnės santykinės ribos;

(26) Reglamente (ES) Nr. 600/2014 nustatyta skaidrumo iki sandorio sudarymo ir po sandorių sudarymo tvarka turėtų būti tinkamai pritaikyta prie rinkos ir taikoma vienodai visoje Sąjungoje. Todėl labai svarbu nustatyti būtinus atliktinus skaičiavimus, taip pat skaičiavimo laikotarpius bei metodus. Šiuo požiūriu, siekiant išvengti iškreipiamojo poveikio rinkai, šiame reglamente nustatytais skaičiavimo laikotarpiais turėtų būti užtikrinta, kad atitinkamos tvarkoje nustatytos ribos būtų atnaujinamos pakankamai periodiškai, kad būtų atsižvelgta į rinkos sąlygas. Taip pat reikia numatyti centralizuotą skaičiavimo rezultatų skelbimą, kad su jais vienoje vietoje ir patogiu būdu galėtų susipažinti visi Sąjungos finansų rinkos dalyviai ir kompetentingos institucijos. Šiuo tikslu kompetentingos institucijos turėtų pranešti EVPRI apie atliktų skaičiavimų rezultatus, o EVPRI tuos rezultatus turėtų paskelbti savo interneto svetainėje;

(27) siekiant užtikrinti sklandų naujų skaidrumo reikalavimų įgyvendinimą, derėtų skaidrumo nuostatas taikyti laipsniškai. Likvidumo riba „sandorių skaičiaus dienos vidurkis“, naudojama siekiant nustatyti obligacijas, kurių rinka yra likvidi, turėtų būti laipsniškai koreguojama;

(28) iki metų, einančių po Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios dienos, liepos 30 d. EVPRI turėtų kasmet Komisijai pateikti apskaičiuotą likvidumo ribą, pagal kurią nustatomos skaidrumo iki sandorio sudarymo pareigos pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 8 ir 9 straipsnius, ir atitinkamais atvejais pateikti peržiūrėtą techninį reguliavimo standartą, kuriuo patikslinama likvidumo riba;

(29) taip pat turėtų būti laipsniškai tikslinami sandorio procentiliai, kuriais remiantis nustatomas priemonei būdingas dydis, dėl kurio suteikiama teisė netaikyti skaidrumo iki sandorio sudarymo pareigų ne nuosavo kapitalo finansinių priemonių atžvilgiu;

(30) šiuo tikslu EVPRI kasmet turėtų Komisijai pateikti apskaičiuotas reikalavimų netaikymo ribas ir atitinkamais atvejais pateikti peržiūrėtą techninį reguliavimo standartą, kuriuo patikslinamos ne nuosavo kapitalo finansinėms priemonėms galiojančios reikalavimų netaikymo ribos;

(31) skaidrumo skaičiavimams atlikti būtini baziniai duomenys, kad būtų galima nustatyti turto poklasį, kuriam priklauso kiekviena finansinė priemonė; Todėl būtina prekybos vietas įpareigoti teikti daugiau bazinių duomenų, nei reikalaujama Komisijos deleguotajame reglamente (ES) 2017/585 ([1]);

(32) nustatant finansines priemones, kurių rinka nėra likvidi užsienio valiutos finansinių išvestinių priemonių atžvilgiu, reikėjo atlikti kokybinį vertinimą, nes trūko duomenų, būtinų išsamiai kiekybinei visos rinkos analizei atlikti. Todėl, kol nėra kokybiškesnių duomenų, taikant šį reglamentą užsienio valiutos finansinių išvestinių priemonių rinka turėtų būti laikoma nelikvidžia;

(33) kad būtų galima veiksmingai pradėti taikyti naujas skaidrumo taisykles, rinkos dalyviai likus pakankamai laiko iki Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios dienos turėtų pateikti duomenis, reikalingus tam, kad būtų galima apskaičiuoti ir paskelbti finansines priemones, kurių rinka nėra likvidi, ir pavedimų, kurie yra didelės apimties arba didesni nei priemonei būdinga, dydžius;

(34) nuoseklumo sumetimais ir siekiant užtikrinti sklandų finansų rinkų veikimą, būtina, kad šis reglamentas ir Reglamente (ES) Nr. 600/2014 išdėstytos nuostatos būtų pradėti taikyti nuo tos pačios dienos. Tačiau, siekiant užtikrinti, kad skaidrumo reguliavimo tvarka būtų veiksmingai taikoma, tam tikros šio reglamento nuostatos turėtų būti taikomos nuo jo įsigaliojimo dienos;

(35) šis reglamentas grindžiamas EVPRI Komisijai pateiktais techninių reguliavimo standartų projektais;

(36) EVPRI dėl techninių reguliavimo standartų projektų, kuriais pagrįstas šis reglamentas, surengė atviras viešas konsultacijas, išnagrinėjo galimas susijusias sąnaudas ir naudą ir paprašė Vertybinių popierių ir rinkų suinteresuotųjų subjektų grupės, įsteigtos Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1095/2010 ([2]) 37 straipsniu, pateikti savo nuomonę,

PRIĖMĖ ŠĮ REGLAMENTĄ:

I SKYRIUS

APIBRĖŽTYS

1 straipsnis

Apibrėžtys

Šiame reglamente vartojamų terminų apibrėžtys:

1. sudėtinis sandoris:

   a) išvestinių ar kitokių finansinių priemonių sandoris, kurio sąlyga – tuo pačiu metu įvykdomas sandoris dėl lygiaverčio pagrindinio fizinio turto kiekio (pakeitimas fiziniu turtu, PFT), arba

   b) sandoris, kuris apima dviejų ar daugiau jį sudarančių finansinių priemonių sandorių vykdymą ir:

      i) kurį vykdo dvi arba daugiau sandorio šalių;

      ii) kiekvienam jį sudarančiam sandoriui būdinga reikšminga ekonominė ar finansinė rizika, susijusi su visais kitais jį sudarančiais sandoriais;

      iii) kiekvienas jį sudarantis sandoris vyksta tuo pačiu metu ir priklauso nuo visų kitų jį sudarančių sandorių įvykdymo;

2. prašymo dėl kotiruotės sistema – prekybos sistema, atitinkanti šias sąlygas:

   a) narys ar dalyvis kotiruotę (-es) pateikia gavęs vieno ar kelių narių ar dalyvių prašymą dėl kotiruotės;

([1]) 2016 m. liepos 14 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/585, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 papildomas techniniais reguliavimo standartais, susijusiais su finansinių priemonių bazinių duomenų standartais bei formatu ir su techninėmis priemonėmis dėl tvarkos, kurią turi nustatyti Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija ir kompetentingos institucijos (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 368).

([2]) 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1095/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija) ir iš dalies keičiamas Sprendimas Nr. 716/2009/EB bei panaikinamas Komisijos sprendimas 2009/77/EB (OL L 331, 2010 12 15, p. 84).

b) pasinaudoti kotiruote gali tik prašymą pateikęs narys ar dalyvis;

c) prašymą pateikęs narys ar rinkos dalyvis gali sudaryti sandorį, sutikdamas su kotiruote (-ėmis), kuri jam pateikta jo prašymu;

3. žodinės prekybos sistema – prekybos sistema, pagal kurią derybos dėl narių sandorių vyksta žodžiu.

II SKYRIUS

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

2 straipsnis

Skaidrumo iki sandorio sudarymo pareigos

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

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

3 straipsnis

Didelės apimties pavedimai

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

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

4 straipsnis

Pavedimų tvarkymo sistemoje laikomų pavedimų rūšis ir minimalus dydis

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

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

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

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

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

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

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

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

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

5 straipsnis

Finansinei priemonei būdingas dydis

(Reglamento (ES) Nr. 600/2014 8 straipsnio 4 dalis ir 9 straipsnio 1 dalies b punktas)

1. Informacinis pranešimas apie susidomėjimą laikomas viršijančiu finansinei priemonei būdingą dydį, jei pateikiant pavedimą arba po bet kurio jo pakeitimo jis yra lygus minimaliam informacinio pranešimo apie susidomėjimą dydžiui, kuris nustatomas pagal 13 straipsnyje nurodytus metodus, arba didesnis.

2. Orientacinės kainos iki sandorio, taikytinos informaciniams pranešimams apie susidomėjimą, kurie viršija finansinei priemonei būdingą dydį, nustatytą pagal 1 dalį, bet yra mažesni nei atitinkamas didelės apimties dydis, nustatytas remiantis 3 straipsniu, laikomos artimomis kainai, kurios atžvilgiu išreikštas prekybinis interesas, kai prekybos vieta paskelbia bent vieną iš šių:

a) siūlomą geriausią kainą;

b) paprastąjį kainų vidurkį;

c) vidutinę kainą, patikslintą remiantis informacinių pranešimų apie susidomėjimą apimtimi, kaina, laiku ar skaičiumi.

3. Prekybos vietą valdantys rinkos operatoriai ir investicinės įmonės, įvesdami ar atnaujindami orientacines kainas iki sandorio sudarymo, paskelbia kainų iki sandorio sudarymo apskaičiavimo metodus ir paskelbimo laiką.

6 straipsnis

Finansinių priemonių, kurių rinka nėra likvidi, klasės

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

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

III SKYRIUS

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

7 straipsnis

Skaidrumo iki sandorio sudarymo pareigos

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

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

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

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

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

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

4. Informacija po sandorio sudarymo pateikiama kuo skubiau po realaus laiko, kiek techniškai įmanoma, ir bet kokiu atveju:

a) per pirmuosius trejus Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo metus – ne vėliau kaip per 15 min. nuo atitinkamo sandorio įvykdymo;

b) paskui – ne vėliau kaip per 5 min. nuo atitinkamo sandorio įvykdymo.

5. Jei dviejų investicinių įmonių sandoris sudaromas ne pagal prekybos vietos taisykles savo sąskaita arba klientų vardu, sandorį per PSS skelbia tik tą finansinę priemonę parduodanti investicinė įmonė.

6. Nukrypstant nuo 5 dalies, jei tik viena iš sandorį sudarančių investicinių įmonių yra sistemingai sandorius dėl atitinkamos finansinės priemonės savo viduje sudarantis tarpininkas ir ji yra perkančioji įmonė, tik ji skelbia sandorį per PSS ir informuoja pardavėją apie veiksmus, kurių imtasi.

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

8. Informacija apie sudėtinį sandorį kiekvieno jį sudarančio sandorio atžvilgiu skelbiama kuo skubiau po realaus laiko, kiek techniškai įmanoma, atsižvelgiant į poreikį nurodyti konkrečių finansinių priemonių kainas ir nurodant sudėtinio sandorio žymą arba pakeitimo fiziniu turtu žymą pagal II priedo 3 lentelę. Kai galima atidėti sudėtinio sandorio paskelbimą pagal 8 straipsnį, informacija apie visus jį sudarančius sandorius pateikiama pasibaigus tam sudėtiniam sandoriui nustatytam atidėjimo laikotarpiui.

8 straipsnis

Atidėtas sandorių skelbimas

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

9 straipsnis

Didelės apimties sandoriai

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

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

10 straipsnis

Finansinei priemonei būdingas dydis

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

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

11 straipsnis

Skaidrumo reikalavimai, susiję su skelbimo atidėjimu kompetentingų institucijų nuožiūra

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

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

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

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

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

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

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

d) valstybės skolos priemonių atveju, kai taikomas Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 3 dalies d punktas, kompetentingos institucijos neribotą laikotarpį leidžia skelbti kelių sandorių, įvykdytų per vieną kalendorinę savaitę, suvestinę kitos savaitės antradienį iki 9.00 vietos laiku.

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

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

b) valstybės skolos priemonių atveju, kai kompetentingos institucijos nusprendžia nepasinaudoti Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 3 dalies b ir d punktuose nurodytomis galimybėmis iš eilės, remiantis Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 3 dalies antra pastraipa, visi atskirų sandorių duomenys skelbiami kitą darbo dieną iki 9.00 vietos laiku;

c) valstybės skolos priemonių atveju, kai kompetentingos institucijos pasinaudoja Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 3 dalies b ir d punktuose nurodytomis galimybėmis iš eilės, remdamosi Reglamento (ES) Nr. 600/2014 11 straipsnio 3 dalies antra pastraipa, kelių sandorių, įvykdytų per vieną kalendorinę savaitę, suvestinė skelbiama kitą antradienį pasibaigus pratęstam keturių savaičių atidėjimo laikotarpiui, skaičiuojant nuo tos kalendorinės savaitės paskutinės dienos, iki 9.00 vietos laiku.

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

4. 1 ir 2 dalyse nurodomose dienos ar savaitės duomenų suvestinėse nurodoma tokia kiekvienos atitinkamo kalendorinio laikotarpio dienos ar savaitės informacija apie obligacijas, struktūrizuotus finansinius produktus, išvestines finansines priemones ir apyvartinius taršos leidimus:

a) vidutinė svertinė kaina;

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

c) bendras sandorių skaičius.

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

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

12 straipsnis

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

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

Pareiga paskelbti sandorių apimtis ir kainas bei jų sudarymo laiką, kaip nurodyta Reglamento (ES) Nr. 600/2014 21 straipsnio 1 dalyje, netaikoma šiems sandoriams:

a) sandoriams, išvardytiems Komisijos deleguotojo reglamento (ES) 2017/590 ([1]) 2 straipsnio 5 dalyje;

b) sandoriams, kuriuos įvykdė Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2009/65/EB ([2]) 2 straipsnio 1 dalies b punkte apibrėžta valdymo įmonė arba Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2011/61/ES ([3]) 4 straipsnio 1 dalies b punkte apibrėžtas alternatyvaus investavimo fondo valdytojas, kurie perduoda tikrąją finansinių priemonių nuosavybės teisę iš vieno kolektyvinio investavimo subjekto kitam, kai sandoryje nedalyvauja jokia investicinė įmonė;

([1]) 2016 m. liepos 28 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/590, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 papildomas techniniais reguliavimo standartais, susijusiais su pranešimu apie sandorius kompetentingoms institucijoms (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 449).

([2]) 2009 m. liepos 13 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2009/65/EB dėl įstatymų ir kitų teisės aktų, susijusių su kolektyvinio investavimo į perleidžiamus vertybinius popierius subjektais (KIPVPS), derinimo (OL L 302, 2009 11 17, p. 32)

([3]) 2011 m. birželio 8 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2011/61/ES dėl alternatyvaus investavimo fondų valdytojų, kuria iš dalies keičiami direktyvos 2003/41/EB ir 2009/65/EB bei reglamentai (EB) Nr. 1060/2009 ir (ES) Nr. 1095/2010 (OL L 174, 2011 7 1, p. 1).

c) perdavimo (perėmimo) sandoriams, kai investicinė įmonė perduoda kliento sandorį kitai investicinei įmonei arba perima kliento sandorį iš kitos investicinės įmonės tvarkymui po sandorio sudarymo atlikti;

d) finansinių priemonių, tokių kaip dvišalio sandorio įkaitas, perdavimui, pagrindinės sandorio šalies (PSŠ) garantinės įmokos ar įkaito reikalavimų vykdymui ir PSŠ įsipareigojimų nevykdymo valdymo procedūrai.

IV SKYRIUS

BENDROS SKAIDRUMO IKI SANDORIO IR PO SANDORIO SUDARYMO NUOSTATOS

13 straipsnis

Skaidrumo skaičiavimų metodai

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

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

a) Statinis likvidumo vertinimas:

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

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

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

iv) kitų palūkanų normų išvestinių finansinių priemonių poklasiams, kitoms biržos prekių išvestinėms finansinėms priemonėms, kitoms kredito išvestinėms finansinėms priemonėms, kitoms C10 išvestinėms finansinėms priemonėms, kitiems sandoriams dėl kainų skirtumo, kitiems apyvartiniams taršos leidimams ir kitoms apyvartinių taršos leidimų išvestinėms finansinėms priemonėms, kaip apibrėžta III priedo 5.1, 7.1, 9.1, 10.1, 11.1, 12.1 ir 13.1 lentelėse.

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

i) visų rūšių obligacijoms, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas, kaip apibrėžta III priedo 2.1 lentelėje ir patikslinta 17 straipsnio 1 dalyje;

ii) biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijų rūšims, kaip apibrėžta III priedo 2.4 lentelėje;

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

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

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

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

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

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

ix) apyvartinių taršos leidimų turto poklasiui, išskyrus kitų apyvartinių taršos leidimų turto poklasį, kaip apibrėžta III priedo 12.1 lentelėje;

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

c) Periodinis vertinimas, pagrįstas kokybiniais likvidumo kriterijais:

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

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

d) Periodinis vertinimas, pagrįstas dviejų patikrinimų metodu, skirtas struktūrizuotiems finansiniams produktams, kaip apibrėžta III priedo 3.1 lentelėje.

2. Siekiant nustatyti 5 straipsnyje nurodytą finansinei priemonei būdingą dydį bei pavedimus, kurie yra didelės apimties, palyginti su 3 straipsnyje nurodytu normaliu rinkos dydžiu, taikytini šie metodai:

a) ribinė vertė:

i) biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijų rūšims, kaip apibrėžta III priedo 2.5 lentelėje;

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

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

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

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

vi) kiekvienam turto poklasiui, kurio rinka nėra likvidi, priklausančiam apyvartinių taršos leidimų ir apyvartinių taršos leidimų išvestinių finansinių priemonių turto klasėms, kaip apibrėžta III priedo 12.3 ir 13.3 lentelėse;

vii) kiekvienam struktūrizuotam finansiniam produktui, jei 1 dalies d punkte nurodytas 1-ojo patikrinimo rezultatas neigiamas, kaip apibrėžta III priedo 3.2 lentelėje;

viii) kiekvienam struktūrizuotam finansiniam produktui, kurio rinka nėra likvidi, jei tik 1-ojo patikrinimo pagal 1 dalies d punktą rezultatas teigiamas, kaip apibrėžta III priedo 3.3 lentelėje;

b) didesnis iš šių dydžių: sandorio dydis, už kurį mažesni sandoriai sudaro sandorio procentilį atitinkančią procentinę dalį, kaip patikslinta 17 straipsnio 3 dalyje, arba minimali ribinė vertė:

i) visų rūšių obligacijoms, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas, kaip apibrėžta III priedo 2.3 lentelėje;

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

iii) kiekvienam turto poklasiui, kurio rinka likvidi, priklausančiam apyvartinių taršos leidimų ir apyvartinių taršos leidimų išvestinių finansinių priemonių turto klasėms, kaip apibrėžta III priedo 12.2 ir 13.2 lentelėse;

iv) kiekvienam struktūrizuotam finansiniam produktui, kurio rinka likvidi, jei 1 dalies d punkte nurodytų 1-ojo ir 2-ojo patikrinimų rezultatai teigiami, kaip apibrėžta III priedo 3.3 lentelėje.

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

a) ribinė vertė:

i) biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijų rūšims, kaip apibrėžta III priedo 2.5 lentelėje;

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

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

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

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

vi) kiekvienam turto poklasiui, kurio rinka nėra likvidi, priklausančiam apyvartinių taršos leidimų ir apyvartinių taršos leidimų išvestinių finansinių priemonių turto klasėms, kaip apibrėžta III priedo 12.3 ir 13.3 lentelėse;

vii) kiekvienam struktūrizuotam finansiniam produktui, jei 1 dalies d punkte nurodytas 1-ojo patikrinimo rezultatas neigiamas, kaip apibrėžta III priedo 3.2 lentelėje;

viii) kiekvienam struktūrizuotam finansiniam produktui, kurio rinka nėra likvidi, jei tik 1-ojo patikrinimo pagal 1 dalies d punktą rezultatas teigiamas, kaip apibrėžta III priedo 3.3 lentelėje;

b) sandorio dydis, už kurį mažesni sandoriai sudaro tokią procentinę dalį, kuri atitinka kiekvienos rūšies obligacijų, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas, kaip apibrėžta III priedo 2.3 lentelėje, sandorio procentilį;

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

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

i) kiekvienam turto poklasiui, kurio rinka likvidi, priklausančiam apyvartinių taršos leidimų ir apyvartinių taršos leidimų išvestinių finansinių priemonių turto klasėms, kaip apibrėžta III priedo 12.2 ir 13.2 lentelėse;

ii) kiekvienam struktūrizuotam finansiniam produktui, kurio rinka likvidi, jei 1 dalies d punkte nurodytų 1-ojo ir 2-ojo patikrinimų rezultatai teigiami, kaip apibrėžta III priedo 3.3 lentelėje.

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

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

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

b) dydžiai, kurie yra didelės apimties, palyginti su normaliu rinkos dydžiu ir priemonei būdingu dydžiu, kaip nurodyta 2 ir 3 dalyse.

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

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

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

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

10. Atliekant skaičiavimus, nurodytus 2 dalies b punkto i papunktyje ir 3 dalies b punkte, 100 000 EUR dydžio ir mažesni sandoriai neįtraukiami.

11. Atliekant vertinimus, nurodytus 2 ir 3 dalyse, 2 dalies b punktas ir 3 dalies b, c ir d punktai netaikytini, jei sandorių, kuriuos ketinama įtraukti į skaičiavimus, skaičius yra mažesnis nei 1 000, tokiu atveju taikant toliau nurodytas ribas:

a) 100 000 EUR – visoms obligacijoms, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas;

b) 2 dalies a punkte ir 3 dalies a punkte nurodytos ribinės vertės – visoms finansinėms priemonėms, kurioms netaikomas šios dalies a punktas.

12. Išskyrus atvejus, kai skaičiavimai susiję su apyvartiniais taršos leidimais ar jų išvestinėmis finansinėmis priemonėmis, atliekant straipsnio 2 dalies b punkte ir 3 dalies b, c ir d punktuose nurodytus skaičiavimus sumos apvalinamos iki šių artimiausių skaičių:

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

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

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

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

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

14. Su nuosavybės vertybiniais popieriais susietų išvestinių finansinių priemonių, kuriomis leidžiama prekiauti ar pirmą kartą prekiaujama prekybos vietoje, kurios nepriklauso poklasiui, kurio atžvilgiu paskelbtas 5 straipsnyje ir 8 straipsnio 1 dalies c punkte nurodytas finansinei priemonei būdingas dydis ir didelės apimties, palyginti su 3 straipsnyje ir 8 straipsnio 1 dalies a punkte nurodytu normaliu rinkos dydžiu, pavedimų bei sandorių dydis, ir kurios priklauso vienam iš 1 dalies a punkto ii papunktyje nurodytų turto poklasių, atveju finansinei priemonei būdingas dydis ir didelės apimties, palyginti su normaliu rinkos dydžiu, pavedimų bei sandorių dydis yra lygūs dydžiams, taikytiniems turto poklasio, kuriam priklauso su nuosavybės vertybiniais popieriais susieta išvestinė finansinė priemonė, mažiausiam dienos tariamosios sumos vidurkio intervalui.

15. Finansinės priemonės, kuriomis leidžiama prekiauti ar pirmą kartą prekiaujama prekybos vietoje, kurios nepriklauso poklasiui, kurio atžvilgiu paskelbtas 5 straipsnyje ir 8 straipsnio 1 dalies c punkte nurodytas finansinei priemonei būdingas dydis ir didelės apimties, palyginti su 3 straipsnyje ir 8 straipsnio 1 dalies a punkte paminėtu normaliu rinkos dydžiu, pavedimų bei sandorių dydis, laikomos neturinčiomis likvidžios rinkos tol, kol bus pradėti taikyti pagal 17 dalį atliktų skaičiavimų rezultatai. Taikytinas 5 straipsnyje ir 8 straipsnio 1 dalies c punkte nurodytas finansinei priemonei būdingas dydis ir didelės apimties, palyginti su 3 straipsnyje ir 8 straipsnio 1 dalies a punkte nurodytu normaliu rinkos dydžiu, pavedimų bei sandorių dydis yra lygūs poklasių, priklausančių tam pačiam turto poklasiui, kurių rinka nėra likvidi, dydžiams.

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

17. Kompetentingos institucijos užtikrina, kad 5 dalyje nurodytų skaičiavimų rezultatai kiekvienos finansinės priemonės ar finansinių priemonių klasės atžvilgiu būtų paskelbti iki metų, kurie eina po Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios dienos, balandžio 30 d. ir iki kiekvienų vėlesnių metų balandžio 30 d. Skaičiavimų rezultatai taikomi nuo kiekvienų metų birželio 1 d. po jų paskelbimo.

18. 1 dalies b punkto i papunktyje nurodytų skaičiavimų tikslu ir nukrypstant nuo 7, 15 ir 17 dalių, kompetentingos institucijos obligacijų, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas, atžvilgiu užtikrina, kad 5 dalies a punkte nurodytų skaičiavimų rezultatai būtų skelbiami kas ketvirtį vasario, gegužės, rugpjūčio ir lapkričio mėn. pirmą dieną po Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios dienos, taip pat kiekvienų tolesnių metų vasario, gegužės, rugpjūčio ir lapkričio mėn. pirmą dieną. Į skaičiavimus įtraukiami sandoriai, įvykdyti Sąjungoje per praėjusį kalendorinį ketvirtį, o jų rezultatai taikomi 3 mėn. laikotarpį, prasidedantį kiekvienų metų vasario, gegužės, rugpjūčio ir lapkričio mėn. pirmą dieną.

19. Laikoma, kad obligacijų, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas, kuriomis leidžiama prekiauti ar pirmą kartą prekiaujama prekybos vietoje per pirmuosius du ketvirčio mėnesius, rinka yra likvidi, kaip nurodyta III priedo 2.2 lentelėje, kol bus pradėti taikyti kalendorinio ketvirčio skaičiavimo rezultatai.

20. Laikoma, kad obligacijų, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas, kuriomis leidžiama prekiauti ar pirmą kartą prekiaujama prekybos vietoje per paskutinį ketvirčio mėnesį, rinka yra likvidi, kaip nurodyta III priedo 2.2 lentelėje, kol bus pradėti taikyti kito kalendorinio ketvirčio skaičiavimo rezultatai.

14 straipsnis

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

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

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

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

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

c) sandoris vykdomas siekiant finansų stabilumo politikos tikslų.

15 straipsnis

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

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

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

a) sandoriams, sudarytiems dėl jo nuosavų lėšų valdymo;

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

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

16 straipsnis

Laikinas skaidrumo reikalavimų taikymo sustabdymas

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

1. Finansinių priemonių, kurių rinka remiantis 13 straipsnyje išdėstytais metodais laikoma likvidžia, atžvilgiu kompetentinga institucija gali laikinai sustabdyti Reglamento (ES) Nr. 600/2014 8 ir 10 straipsniuose nurodytų pareigų taikymą, kai tam tikros klasės obligacijų, struktūrizuotų finansinių produktų, apyvartinių taršos leidimų ar išvestinių finansinių priemonių bendra apimtis, kaip apibrėžta II priedo 4 lentelėje, per pastarąsias 30 kalendorinių dienų sudarė mažiau nei 40 % mėnesio apimties vidurkio, apskaičiuoto pagal 12 visos trukmės kalendorinių mėnesių, ėjusių prieš tas 30 kalendorinių dienų.

2. Finansinių priemonių, kurių rinka remiantis 13 straipsnyje išdėstytais metodais laikoma nelikvidžia, atžvilgiu kompetentinga institucija gali laikinai sustabdyti Reglamento (ES) Nr. 600/2014 8 ir 10 straipsniuose nurodytų pareigų taikymą, kai obligacijų, struktūrizuotų finansinių produktų, apyvartinių taršos leidimų ar išvestinių finansinių priemonių klasės bendra apimtis, kaip apibrėžta II priedo 4 lentelėje, per pastarąsias 30 kalendorinių dienų sudarė mažiau nei 20 % mėnesio apimties vidurkio, apskaičiuoto pagal 12 visos trukmės kalendorinių mėnesių, ėjusių prieš tas 30 kalendorinių dienų.

3. Atlikdamos 1 ir 2 dalyse nurodytus skaičiavimus, kompetentingos institucijos atsižvelgia į sandorius, įvykdytus visose Sąjungos prekybos vietose dėl atitinkamos klasės obligacijų, struktūrizuotų finansinių produktų, apyvartinių taršos leidimų ar išvestinių finansinių priemonių. Skaičiavimai atliekami pagal finansinių priemonių klases, kurioms taikomas 13 straipsnyje nurodytas likvidumo patikrinimas.

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

17 straipsnis

Nuostatos dėl obligacijų likvidumo įvertinimo ir dėl priemonei būdingo dydžio iki sandorio sudarymo ribų nustatymo pagal sandorio procentilius

1. Siekiant nustatyti obligacijas, kurių rinka nėra likvidi taikant 6 straipsnį ir remiantis 13 straipsnio 1 dalies b punkte nurodytais metodais, naudotinas likvidumo kriterijus „sandorių skaičiaus dienos vidurkis“, taikant sandorių skaičiaus dienos vidurkį, atitinkantį S1 etapą (15 sandorių per dieną).

2. Laikoma, kad įmonių obligacijų ir padengtų obligacijų, kuriomis leidžiama prekiauti ar pirmą kartą prekiaujama prekybos vietoje, rinka yra likvidi, kol pradedami taikyti pirmojo ketvirtinio likvidumo vertinimo rezultatai, kaip numatyta 13 straipsnio 18 dalyje, kai:

a) emisijos dydis viršija 1 000 000 000 EUR per S1 ir S2 etapus, kaip nustatyta pagal 6 dalį;

b) emisijos dydis viršija 500 000 000 EUR per S3 ir S4 etapus, kaip nustatyta pagal 6 dalį.

3. Nustatant finansinei priemonei būdingą dydį pagal 5 straipsnio nuostatas ir remiantis 13 straipsnio 2 dalies b punkte nurodytais metodais, naudojamas taikytino sandorio procentilio metodas, taikant sandorio procentilį, atitinkantį S1 etapą (30-asis procentilis).

4. Iki metų, einančių po Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios dienos, liepos 30 d. ir iki kiekvienų vėlesnių metų liepos 30 d. EVPRI Komisijai pateikia obligacijoms taikomo likvidumo kriterijaus „sandorių skaičiaus dienos vidurkis“ ir 8 dalyje numatytų sandorio procentilių, pagal kuriuos nustatomas finansinei priemonei būdingas dydis, ribų taikymo įvertinimą. Pareiga pateikti ribų taikymo įvertinimą, susijusį su obligacijoms taikomu likvidumo kriterijumi „sandorių skaičiaus dienos vidurkis“, nebetaikoma, kai pasiekiamas 6 dalyje nurodytas S4 sekos etapas. Pareiga pateikti sandorio procentilių įvertinimą nebetaikoma, kai pasiekiamas 8 dalyje nurodytas S4 sekos etapas.

5. Rengiant 4 dalyje nurodytą įvertinimą, atsižvelgiama į:

a) ne nuosavo kapitalo finansinių priemonių, kurioms taikytinos skaidrumo iki sandorio sudarymo pareigos pagal Reglamento (ES) Nr. 600/2014 8 ir 9 straipsnius, prekybos apimties raidą;

b) procentiliais nurodytų ribų, naudojamų nustatant finansinei priemonei būdingą dydį, poveikį likvidumą užtikrinantiems subjektams;

c) visus kitus svarbius veiksnius.

6. Atsižvelgdama į įvertinimą, atliktą pagal 4 ir 5 punktus, EVPRI pateikia Komisijai naujos redakcijos techninį reguliavimo standartą, kurioje obligacijoms taikomo likvidumo kriterijaus „sandorių skaičiaus dienos vidurkis“ riba patikslinama pagal tokią seką:

a) S2 (10 sandorių per dieną) iki metų, einančių po Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios dienos, liepos 30 d.;

b) S3 (7 sandoriai per dieną) iki kiekvienų vėlesnių metų liepos 30 d.;

c) S4 (2 sandoriai per dieną) iki kiekvienų vėlesnių metų liepos 30 d.

7. Jeigu EVPRI nepateikia naujos redakcijos techninio reguliavimo standarto, kuriuo riba perkeliama į kitą etapą pagal 6 dalyje nurodytą seką, EVPRI įvertinime, atliktame pagal 4 ir 5 dalis, paaiškinama, kodėl perkelti ribą į kitą atitinkamą etapą nėra pagrindo. Tokiu atveju perkėlimas į kitą etapą atidedamas vieniems metams.

8. Atsižvelgdama į įvertinimą, atliktą pagal 4 ir 5 punktus, EVPRI pateikia Komisijai naujos redakcijos techninį reguliavimo standartą, kuriame sandorio procentilių riba patikslinama pagal šią seką:

a) S2 (40-asis procentilis) iki metų, einančių po Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios dienos, liepos 30 d.;

b) S3 (50-asis procentilis) iki kiekvienų vėlesnių metų liepos 30 d.;

c) S4 (60-asis procentilis) iki kiekvienų vėlesnių metų liepos 30 d.

9. Jeigu EVPRI nepateikia naujos redakcijos techninio reguliavimo standarto, kuriuo riba perkeliama į kitą etapą pagal 8 dalyje nurodytą seką, EVPRI įvertinime, atliktame pagal 4 ir 5 dalis, paaiškinama, kodėl perkelti ribą į kitą atitinkamą etapą nėra pagrindo. Tokiu atveju perkėlimas į kitą etapą atidedamas vieniems metams.

18 straipsnis

Pereinamojo laikotarpio nuostatos

1. Kompetentingos institucijos ne vėliau nei likus šešiems mėnesiams iki Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios dienos surenka reikiamus duomenis, apskaičiuoja 13 straipsnio 5 dalyje nurodytus duomenis ir užtikrina jų paskelbimą.

2. Taikant 1 dalį:

a) skaičiavimai turėtų būti pagrįsti šešių mėn. ataskaitiniu laikotarpiu, kuris prasideda likus 18 mėn. iki Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios dienos;

b) pirmą kartą paskelbti skaičiavimų rezultatai naudojami tol, kol bus pradėti taikyti 13 straipsnio 17 dalyje nurodytų pirmųjų periodinių skaičiavimų rezultatai.

3. Nukrypstant nuo 1 dalies, visų obligacijų, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas, atžvilgiu kompetentingos institucijos deda visas pastangas užtikrinti, kad 13 straipsnio 1 dalies b punkto i papunktyje nurodytų skaidrumo skaičiavimų rezultatai būtų paskelbti ne vėliau nei mėnesio, einančio prieš Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios dieną, pirmą dieną, remiantis trijų mėnesių ataskaitiniu laikotarpiu, prasidedančiu penkto mėnesio, einančio prieš Reglamento (ES) Nr. 600/2014 taikymo pradžios dieną, pirmą dieną.

4. Kompetentingos institucijos, rinkos operatoriai ir investicinės įmonės, įskaitant prekybos vietą valdančias investicines įmones, naudoja pagal 3 dalį paskelbtą informaciją tol, kol bus pradėti taikyti 13 straipsnio 18 dalyje nurodytų pirmųjų periodinių skaičiavimų rezultatai.

5. Laikoma, kad obligacijų, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas, kuriomis leidžiama prekiauti ar pirmą kartą prekiaujama prekybos vietoje per trijų mėnesių laikotarpį iki Reglamento (ES) Nr. 600/2014 įsigaliojimo dienos, rinka nėra likvidi, kaip nurodyta III priedo 2.2 lentelėje, tol, kol bus pradėti taikyti 13 straipsnio 18 dalyje nurodytų pirmųjų periodinių skaičiavimų rezultatai.

19 straipsnis

Įsigaliojimas ir taikymas

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

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

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.

Priimta Briuselyje 2016 m. liepos 14 d.

Komisijos vardu

Pirmininkas

Jean-Claude JUNCKER

I PRIEDAS

Sistemos rūšies aprašymas ir pagal 2 straipsnį viešai skelbtina susijusi informacija

Pagal 2 straipsnį viešai skelbtina informacija

Sistemos rūšis	Sistemos aprašymas	Viešai skelbtina informacija
Nepertraukiamo pavedimų knygos aukciono prekybos sistema	Sistema, kuri pagal pavedimų knygą ir prekybos algoritmą, kuris veikia be žmogaus įsikišimo, remdamasi geriausia turima kaina, nenutrūkstamai derina pavedimus parduoti su pavedimais pirkti.	Kiekvienos finansinės priemonės atžvilgiu – bendras pavedimų skaičius ir atitinkama jų apimtis pagal kiekvieną kainos lygį, nurodant bent penkis geriausios pirkimo ir pardavimo kainos lygius.
Kotiravimu pagrįsta prekybos sistema	Sistema, kurioje sandoriai vykdomi remiantis tvirtosiomis kotiruotėmis, kurios nepertraukiamai skelbiamos dalyviams; o tam rinkos formuotojai turi išlaikyti kotiruotes tokio lygio, kad būtų subalansuoti narių ir dalyvių poreikiai, kad jie galėtų atlikti komercinės apimties sandorius, ir rinkos formuotojams galima rizika.	Kiekvienos finansinės priemonės atžvilgiu – kiekvieno tos priemonės rinkos formuotojo pasiūlyta geriausia pirkimo ir pardavimo kaina kartu su apimtimi, susijusia su tomis kainomis. Viešai skelbiamos kotiruotės – kotiruotės, pagal kurias įsipareigojama pirkti ir parduoti finansines priemones ir kuriose nurodyta finansinių priemonių, kurias registruotieji rinkos formuotojai yra pasirengę pirkti ar parduoti, kaina ir apimtis. Tačiau neįprastomis rinkos sąlygomis ribotą laikotarpį gali būti leidžiamos tik orientacinės, tik pasiūlos arba tik paklausos kainos.
Reguliaraus pavedimų knygos aukciono prekybos sistema	Sistema, kuri derina pavedimus pagal reguliarų aukcioną ir prekybos algoritmą, kuris veikia be žmogaus įsikišimo.	Kiekvienos finansinės priemonės atžvilgiu – kaina, kuriai esant aukciono prekybos sistema geriausiai atitiktų sistemos prekybos algoritmą, ir apimtis, kurią ta kaina galėtų įvykdyti tos sistemos dalyviai.
Prašymo dėl kotiruotės prekybos sistema	Prekybos sistema, kurios narys (-iai) ar dalyvis (-iai) kotiruotę (-es) pateikia gavęs (-ę) vieno ar kelių narių ar dalyvių prašymą dėl kotiruotės. Pasinaudoti kotiruote gali tik prašymą pateikęs narys ar dalyvis. Prašantysis narys arba dalyvis gali sudaryti sandorį, sutikdamas su kotiruote (-ėmis), kuri (-ios) jam pateikta (-os) jo prašymu.	Iš bet kokio nario ar dalyvio gautos kotiruotės ir susijusi apimtis, su kuriomis sutikus pagal sistemos taisykles būtų sudarytas sandoris. Visos kotiruotės, pateiktos pagal prašymą dėl kotiruočių, gali būti skelbiamos vienu metu, bet ne vėliau nei tada, kai jos tampa vykdytinomis.
Žodinės prekybos sistema	Prekybos sistema, kai narių sandoriai derinami žodinėmis derybomis.	Iš bet kokio nario ar dalyvio gauti pasiūlymai pirkti ir parduoti bei susijusi apimtis, su kuriais sutikus pagal sistemos taisykles būtų sudarytas sandoris.
Prekybos sistema, neįtraukta į pirmas 5 eilutes	Mišri sistema, priskiriama dviem ar daugiau iš šių pirmųjų penkių eilučių, arba sistema, kurios kainos nustatymo procesas skiriasi nuo pirmose penkiose eilutėse aprašytų tipų sistemų kainų nustatymo proceso.	Reikiama informacija apie pavedimų ar kotiruočių bei prekybinio intereso lygius, visų pirma nurodant kiekvieno priemonės rinkos formuotojo penkis geriausių pardavimo ir pirkimo kainų lygius ir (arba) pasiūlos ir paklausos kotiruotę, jeigu tai įmanoma atsižvelgiant į kainos nustatymo mechanizmo savybes.

II PRIEDAS

Viešai skelbtini sandorių duomenys

1 lentelė

2 lentelės simbolių lentelė

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

2 lentelė

Duomenų, teiktinų skaidrumo po sandorio sudarymo tikslu, sąrašas

Duomenys	Finansinės priemonės	Aprašymas/skelbtini duomenys	Vykdymo/skelbimo vietos rūšis	Pagal 1 lentelės nurodymus įrašytinas formatas
Prekybos data ir laikas	Visoms finansinėms priemonėms	Data ir laikas, kada buvo įvykdytas sandoris.	Reguliuojama rinka (RR), daugiašalė prekybos sistema (DPS), organizuotos prekybos sistema (OPS)	{DATE_TIME_FORMAT}

Duomenys	Finansinės priemonės	Aprašymas/skelbtini duomenys	Vykdymo/skelbimo vietos rūšis	Pagal 1 lentelės nurodymus įrašytinas formatas
		Prekybos vietoje įvykdytų sandorių atveju detalumo lygis atitinka reikalavimus, nustatytus Deleguotojo reglamento (ES) 2017/574 [1] 3 straipsnyje. Ne prekybos vietoje sudaromų sandorių atveju nurodoma ta data ir laikas, kai šalys susitarė dėl toliau nurodytų laukelių turinio: kiekio, kainos, valiutų (31, 34 ir 40 laukeliai, kaip nurodyta Deleguotojo reglamento (ES) 2017/590 I priedo 2 lentelėje), priemonės identifikavimo kodo, priemonės klasifikacijos ir pagrindinės priemonės kodo laukelių, kai taikoma. Ne prekybos vietoje įvykdytų sandorių atveju laikas pranešamas bent sekundės tikslumu. Jei sandoris sudarytas vykdančiajai įmonei kliento vardu perdavus trečiajai šaliai pavedimą, kai Deleguotojo reglamento (ES) 2017/590 5 straipsnyje nustatytos perdavimo sąlygos neįvykdytos, nurodoma sandorio data ir laikas, o ne pavedimo perdavimo laikas.	Patvirtintas skelbimo subjektas (PSS) Konsoliduotos informacinės juostos teikėjas (KIJT)	
Priemonės identifikavimo kodo tipas	Visoms finansinėms priemonėms	Finansinei priemonei identifikuoti naudojamas kodo tipas	RR, DPS, OPS PSS KIJT	ISIN – ISIN kodas, jei toks yra OTHR – kitas identifikatorius
Priemonės identifikavimo kodas	Visoms finansinėms priemonėms	Finansinei priemonei identifikuoti naudojamas kodas	RR, DPS, OPS PSS KIJT	{ISIN} Jei priemonės identifikavimo kodas nėra ISIN kodas, identifikavimo kodas, kuriuo žymima išvestinė finansinė priemonė pagal 3–5, 7 ir 8, 12–42 laukelius, kaip nurodyta IV priede, ir 13 ir 24–48 laukelius, kaip nurodyta Deleguotojo reglamento (ES) 2017/585 priede, bei išvestinių finansinių priemonių grupė, nustatomas pagal III priedą.
Kaina	Visoms finansinėms priemonėms	Sandorio vykdymo kaina be komisinių ir sukauptų palūkanų (jei taikytina).	RR, DPS, OPS PSS KIJT	{DECIMAL-18/13} – jei kaina išreikšta pinigine verte

Duomenys	Finansinės priemonės	Aprašymas/skelbtini duomenys	Vykdymo/skelbimo vietos rūšis	Pagal 1 lentelės nurodymus įrašytinas formatas
		Pasirinkimo sandorių atveju tai yra išvestinės finansinės priemonės sandorio priedas vienai pagrindinei finansinei priemonei arba indekso punktui. Pirkimo ir pardavimo kainų skirtumo lažybų sandorių (angl. *spread bets*) atveju tai yra pagrindinės finansinės priemonės referencinė kaina. Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių (angl. CDS) atveju tai yra atkarpa baziniais punktais. Jei kaina nurodoma pinigine išraiška, ji turi būti nurodyta pagrindinės valiutos vienetu. Kai kaina šiuo metu nežinoma, tačiau netrukus bus žinoma, turėtų būti įrašyta vertė „PNDG“. Kai kaina netaikoma, laukelis nepildomas. Šiame laukelyje pateikta informacija turi atitikti laukelyje „Kiekis“ nurodytą vertę.		{DECIMAL-11/10} – jei kaina išreikšta procentine dalimi arba pajamingumu PNDG – jei kaina nežinoma {DECIMAL-18/17} – jei kaina išreikšta baziniais punktais
Įvykdymo vieta	Visoms finansinėms priemonėms	Vietos, kurioje buvo įvykdytas sandoris, identifikavimas. Prekybos vietoje įvykdytų sandorių atveju naudoti ISO 10383 segmento rinkos identifikavimo kodą (MIC). Kai MIC segmentas neegzistuoja, naudoti veiklos MIC kodą. Naudoti MIC kodą „XOFF“ finansinėms priemonėms, kuriomis leidžiama prekiauti arba prekiaujama prekybos vietoje, jei tos finansinės priemonės sandoris nėra vykdomas prekybos vietoje, per sistemingai sandorius savo viduje sudarantį tarpininką arba organizuotą prekybos platformą už Sąjungos ribų. Naudoti SINT finansinėms priemonėms, kuriomis leidžiama prekiauti arba prekiaujama prekybos vietoje, kai tos finansinės priemonės sandoris įvykdytas per sistemingai sandorius savo viduje sudarantį tarpininką.	RR, DPS, OPS PSS KIJT	{MIC} – prekybos vietos SINT – sistemingai sandorius savo viduje sudarantis tarpininkas
Kainos žymėjimas	Visoms finansinėms priemonėms	Nurodyti, ar kaina išreikšta pinigine verte, procentine dalimi ar pajamingumu.	RR, DPS, OPS PSS KIJT	MONE – piniginė vertė PERC – procentinė dalis YIEL – pajamingumas BAPO – baziniai punktai
Kainos valiuta	Visoms finansinėms priemonėms	Valiuta, kuria išreikšta kaina (taikytina, jeigu kaina išreikšta pinigine verte).	RR, DPS, OPS PSS KIJT	{CURRENCYCODE_3}

Duomenys	Finansinės priemonės	Aprašymas/skelbtini duomenys	Vykdymo/skelbimo vietos rūšis	Pagal 1 lentelės nurodymus įrašytinas formatas
Kiekio nuoroda matavimo vienetais	Biržos prekių išvestinėms finansinėms priemonėms, apyvartinių taršos leidimų išvestinėms finansinėms priemonėms ir apyvartiniams taršos leidimams, išskyrus šio reglamento 11 straipsnio 1 dalies a ir b punktuose nurodytus atvejus.	Nurodyti matavimo vienetus, kuriais išreikštas kiekis	RR, DPS, OPS PSS KIJT	TOCD – anglies dioksido ekvivalento tonos arba kitu atveju {ALPHANUM-25}
Kiekis matavimo vienetais	Biržos prekių išvestinėms finansinėms priemonėms, apyvartinių taršos leidimų išvestinėms finansinėms priemonėms ir apyvartiniams taršos leidimams, išskyrus šio reglamento 11 straipsnio 1 dalies a ir b punktuose nurodytus atvejus.	Atitinkamas parduodamų biržos prekių arba apyvartinių taršos leidimų kiekis matavimo vienetais	RR, DPS, OPS PSS KIJT	{DECIMAL-18/17}
Kiekis	Visoms finansinėms priemonėms, išskyrus šio reglamento 11 straipsnio 1 dalies a ir b punktuose nurodytus atvejus.	Finansinės priemonės vienetų skaičius arba sandorį sudarančių išvestinių finansinių priemonių sutarčių skaičius	RR, DPS, OPS PSS KIJT	{DECIMAL-18/17}
Tariamoji suma	Visoms finansinėms priemonėms, išskyrus šio reglamento 11 straipsnio 1 dalies a ir b punktuose nurodytus atvejus.	Nominalioji arba tariamoji suma. Pirkimo ir pardavimo kainų skirtumo lažybų sandorių atveju nominalioji suma yra piniginė vertė, kuria lažinamasi, pagrindinės finansinės priemonės vieno punkto pokyčiui. Kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių atveju tai yra tariamoji suma, kurios atžvilgiu įgyjama arba suteikiama apsauga. Šiame laukelyje pateikta informacija turi atitikti laukelyje „Kaina“ nurodytą vertę.	RR, DPS, OPS PSS KIJT	{DECIMAL-18/5}
Tariamosios sumos valiuta	Visoms finansinėms priemonėms, išskyrus Reglamento 11 straipsnio 1 dalies a ir b punktuose nurodytus atvejus	Valiuta, kuria denominuota tariamoji suma	RR, DPS, OPS PSS KIJT	{CURRENCYCODE_3}

Duomenys	Finansinės priemonės	Aprašymas/skelbtini duomenys	Vykdymo/skelbimo vietos rūšis	Pagal 1 lentelės nurodymus įrašytinas formatas
Rūšis	Apyvartiniams taršos leidimams ir apyvartinių taršos leidimų išvestinėms finansinėms priemonėms	Šis laukelis taikytinas tik apyvartiniams taršos leidimams ir apyvartinių taršos leidimų išvestinėms finansinėms priemonėms.	RR, DPS, OPS PSS KIJT	EUAA – EUA (apyvartinis taršos leidimas) CERE – CER (patvirtintas išmetamųjų teršalų mažinimo vienetas) ERUE – ERU (išmetamųjų teršalų mažinimo vienetas) EUAA – EUAA (aviacijos apyvartinis taršos leidimas) OTHR – kita (tik išvestinėms finansinėms priemonėms)
Paskelbimo data ir laikas	Visoms finansinėms priemonėms	Data ir laikas, kada prekybos vieta arba PSS paskelbė sandorį. Prekybos vietoje įvykdytų sandorių atveju detalumo lygis atitinka reikalavimus, nustatytus Deleguotojo reglamento (ES) 2017/574 2 straipsnyje. Ne prekybos vietoje įvykdytų sandorių atveju laikas pranešamas bent sekundės tikslumu.	RR, DPS, OPS PSS KIJT	{DATE_TIME_FORMAT}
Paskelbimo vieta	Visoms finansinėms priemonėms	Kodas, naudojamas sandorį skelbiančiai prekybos vietai ir PSS identifikuoti	KIJT	Prekybos vieta: {MIC} PSS: {MIC}, jei yra. Kitu atveju – 4 ženklų kodas, paskelbtas EVPRI svetainėje pateiktame duomenų teikimo paslaugų teikėjų sąraše.
Sandorio identifikavimo kodas	Visoms finansinėms priemonėms	Raidinis skaitinis kodas, kurį priskiria prekybos vietos (remdamosi Komisijos deleguotojo reglamento (ES) 2017/580 [2] 12 straipsniu) bei PSS ir kuris naudojamas visose vėlesnėse nuorodose į konkretų sandorį. Sandorio identifikavimo kodas yra unikalus, nuoseklus ir nekintantis kiekvienam ISO 10383 segmento MIC kodui ir kiekvienai prekybos dienai. Kai prekybos vieta nenaudoja segmento MIC kodų, sandorio identifikavimo kodas yra unikalus, nuoseklus ir nekintantis kiekvienam veiklos MIC kodui kiekvieną prekybos dieną. Kai PSS nenaudoja MIC kodų, tai turėtų būti unikalus, nuoseklus ir nekintantis 4 ženklų kodas, naudojamas PSS identifikuoti kiekvieną prekybos dieną. Sandorio identifikavimo kodo komponentai neatskleidžia sandorio, kurio kodas saugomas, šalių tapatybės.	RR, DPS, OPS PSS KIJT	{ALPHANUMERICAL-52}

Duomenys	Finansinės priemonės	Aprašymas/skelbtini duomenys	Vykdymo/skelbimo vietos rūšis	Pagal 1 lentelės nurodymus įrašytinas formatas
Tarpuskaitiniai sandoriai	Išvestinėms finansinėms priemonėms	Kodas, parodantis, ar sandorio tarpuskaita bus atlikta	RR, DPS, OPS PSS KIJT	„true“ – sandorio tarpuskaita turi būti atlikta „false“ – sandorio tarpuskaita neturi būti atlikta

(1) 2016 m. birželio 7 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/574, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2014/65/ES papildoma verslo laikrodžių tikslumo lygio techniniais reguliavimo standartais (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 148).

(2) 2016 m. birželio 24 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2017/580, kuriuo Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 600/2014 papildomas finansinių priemonių pavedimų atitinkamų duomenų laikymo techniniais reguliavimo standartais (žr. šio Oficialiojo leidinio p. 193).

3 lentelė

Žymų sąrašas skaidrumo po sandorio sudarymo tikslais

	Žyma	Žymos pavadinimas	Vykdymo/skelbimo vietos rūšis	Aprašymas
	BENC	Lyginamojo indekso sandorių žyma	RR, DPS, OPS PSS KIJT	Įvairių rūšių pagal apimtį patikslintos vidutinės kainos sandoriai ir visi kiti sandoriai, kurių kaina skaičiuojama įvairiais intervalais, remiantis konkrečiu lyginamuoju indeksu.
	ACTX	Abipusio tarpininkavimo sandorio žyma	PSS KIJT	Sandoriai, kuriuose investicinė įmonė suderina dviejų klientų pavedimus ir pirkimas bei pardavimas vykdomi kaip vienas sandoris dėl tos pačios apimties ir kainos.
	NPFT	Su kainodara nesusijusių sandorių žyma	RR, DPS, OPS KIJT	Šio reglamento 12 straipsnyje išvardyti visų rūšių sandoriai, kurie neturi įtakos kainodarai.
	LRGS	Didelės apimties sandorio paskelbimo po sandorio sudarymo žyma	RR, DPS, OPS PSS KIJT	Įvykdyti sandoriai, kurių paskelbimas po sandorio sudarymo atidedamas dėl didelės apimties.
	ILQD	Nelikvidžių priemonių sandorio žyma	RR, DPS, OPS PSS KIJT	Sandoriai su likvidžios rinkos neturinčiomis priemonėmis, kurių paskelbimas atidėtas.
	SIZE	Sandorių taikant priemonei būdingą dydį po sandorio sudarymo žyma	RR, DPS, OPS PSS KIJT	Įvykdyti sandoriai, kurių paskelbimas po sandorio sudarymo atidedamas dėl priemonei būdingo dydžio.
	TPAC	Sudėtinio sandorio žyma	RR, DPS, OPS PSS KIJT	Sudėtiniai sandoriai, išskyrus pakeitimą fiziniu turtu, kaip apibrėžta 1 straipsnyje.

	Žyma	Žymos pavadinimas	Vykdymo/skelbimo vietos rūšis	Aprašymas
	XFPH	Pakeitimo fiziniu turto sandorio žyma	RR, DPS, OPS PSS KIJT	Pakeitimas fiziniu turtu, kaip apibrėžta 1 straipsnyje.
	CANC	Anuliavimo žyma	RR, DPS, OPS PSS KIJT	Kai atšauktas anksčiau paskelbtas sandoris.
	AMND	Pakeitimo žyma	RR, DPS, OPS PSS KIJT	Kai pakeistas anksčiau paskelbtas sandoris.

PAPILDOMOS ATIDĖJIMO ŽYMOS

11 straipsnio 1 dalies a punkto i papunktis.	LMTF	Ribotų duomenų žyma	RR, DPS, OPS PSS KIJT	Pirmasis pranešimas, paskelbiant ribotus duomenis pagal 11 straipsnio 1 dalies a punkto i papunktį.
	FULF	Išsamių duomenų žyma		Sandoriai, kurių riboti duomenys jau buvo paskelbti pagal 11 straipsnio 1 dalies a punkto i papunktį.
11 straipsnio 1 dalies a punkto ii papunktis	DATF	Sandorių dienos suvestinės žyma	RR, DPS, OPS PSS KIJT	Dienos sandorių suvestinės skelbimas pagal 11 straipsnio 1 dalies a punkto ii papunktį.
	FULA	Išsamių duomenų žyma	RR, DPS, OPS PSS KIJT	Atskiri sandoriai, kurių duomenų suvestinės jau buvo paskelbtos pagal 11 straipsnio 1 dalies a punkto ii papunktį.
11 straipsnio 1 dalies b punktas	VOLO	Neskelbiamos apimties žyma	RR, DPS, OPS PSS KIJT	Sandoriai, kurių riboti duomenys skelbiami pagal 11 straipsnio 1 dalies b punktą.
	FULV	Išsamių duomenų žyma	RR, DPS, OPS PSS KIJT	Sandoriai, kurių riboti duomenys jau buvo paskelbti pagal 11 straipsnio 1 dalies b punktą.
11 straipsnio 1 dalies c punktas	FWAF	Keturių sav. suvestinės žyma	RR, DPS, OPS PSS KIJT	Sandorių suvestinių skelbimas pagal 11 straipsnio 1 dalies c punktą.
	FULJ	Išsamių duomenų žyma	RR, DPS, OPS PSS KIJT	Atskiri sandoriai, anksčiau paskelbti suvestinėse pagal 11 straipsnio 1 dalies c punktą.

	Žyma	Žymos pavadinimas	Vykdymo/skelbimo vietos rūšis	Aprašymas
11 straipsnio 1 dalies d punktas	IDAF	Skelbimo suvestinėse neribotą laikotarpį žyma	RR, DPS, OPS PSS KIJT	Sandoriai, kuriuos pagal 11 straipsnio 1 dalies d punktą leidžiama neribotą laiką skelbti keleto sandorių suvestinėse.
11 straipsnio 1 dalies b punkto ir 11 straipsnio 2 dalies c punkto nuoseklus taikymas valstybės skolos priemonių atžvilgiu	VOLW	Neskelbiamos apimties žyma	RR, DPS, OPS PSS KIJT	Sandoriai, kurių riboti duomenys skelbiami pagal 11 straipsnio 1 dalies c punktą ir kurių bendras keleto sandorių suvestines skelbti neribotą laiką bus nuosekliai leidžiama pagal 11 straipsnio 2 dalies c punktą.
	COAF	Nuoseklaus suvestinių skelbimo žyma (neskelbiant valstybės skolos priemonių apimties)	RR, DPS, OPS PSS KIJT	Sandoriai, kurių riboti duomenys buvo anksčiau paskelbti pagal 11 straipsnio 1 dalies b punktą ir kurių bendras keleto sandorių suvestines nuosekliai skelbti neribotą laiką leista pagal 11 straipsnio 2 dalies c punktą.

4 lentelė

Apimties matas

Priemonės rūšis	Apimtis
Visos obligacijos, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas, ir struktūrizuoti finansiniai produktai	Bendra nominalioji skolos priemonių, kuriomis prekiaujama, vertė
Biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijų rūšys	Vienetų, kuriais prekiaujama, skaičius ([1])
Vertybiniais popieriais pakeistos išvestinės finansinės priemonės	Vienetų, kuriais prekiaujama, skaičius ([1])
Palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės	Tariamoji sutarčių, kuriomis prekiaujama, suma
Užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės	Tariamoji sutarčių, kuriomis prekiaujama, suma
Su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės	Tariamoji sutarčių, kuriomis prekiaujama, suma
Biržos prekių išvestinės finansinės priemonės	Tariamoji sutarčių, kuriomis prekiaujama, suma
Kredito išvestinės finansinės priemonės	Tariamoji sutarčių, kuriomis prekiaujama, suma
Sandoris dėl kainų skirtumo	Tariamoji sutarčių, kuriomis prekiaujama, suma
C10 išvestinės finansinės priemonės	Tariamoji sutarčių, kuriomis prekiaujama, suma
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės	Anglies dioksido ekvivalento tonos
Apyvartiniai taršos leidimai	Anglies dioksido ekvivalento tonos

([1]) Vieneto kaina.

III PRIEDAS

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

1. **Paaiškinimai dėl šio priedo paskirties**

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

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

3. Nuoroda „poklasis“ reiškia turto poklasį, suskaidytą į smulkesnius segmentus, remiantis tolesnio kokybinio segmentavimo kriterijais, išdėstytais šio priedo 2.1–13.3 lentelėse.

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

5. Dienos tariamosios sumos vidurkis – bendra konkrečios finansinės priemonės tariamoji suma, apskaičiuota pagal II priedo 4 lentelėje nurodytą apimties matą ir pasiekta per 13 straipsnio 18 dalyje nurodytą laikotarpį prekiaujant visomis obligacijoms, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas, ir per 13 straipsnio 7 dalyje nurodytą laikotarpį prekiaujant visomis kitomis finansinėmis priemonėmis, padalyta iš to laikotarpio arba atitinkamais atvejais tos metų dalies, kuriais finansine priemone buvo leista prekiauti ar prekiaujama prekybos vietoje ir jos prekyba nebuvo sustabdyta, prekybos dienų skaičiaus.

6. Dienų, kuriomis prekiauta, procentinė dalis nagrinėjamo laikotarpio atžvilgiu – dienų skaičius laikotarpyje, kuris nustatytas 13 straipsnio 18 dalyje visoms obligacijoms, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas, ir 13 straipsnio 7 dalyje struktūrizuotiems finansiniams produktams ir per kurį įvykdytas bent vienas tos finansinės priemonės sandoris, padalytas iš to laikotarpio arba atitinkamais atvejais tos metų dalies, kuriais finansine priemone buvo leista prekiauti ar prekiaujama prekybos vietoje ir jos prekyba nebuvo sustabdyta, prekybos dienų skaičiaus.

7. Sandorių skaičiaus dienos vidurkis – bendras įvykdytų konkrečios finansinės priemonės sandorių skaičius per 13 straipsnio 18 dalyje nurodytą laikotarpį prekiaujant visomis obligacijoms, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas, ir per 13 straipsnio 7 dalyje nurodytą laikotarpį prekiaujant visomis kitomis finansinėmis priemonėmis, padalytas iš to laikotarpio arba atitinkamais atvejais tos metų dalies, kuriais finansine priemone buvo leista prekiauti ar prekiaujama prekybos vietoje ir jos prekyba nebuvo sustabdyta, prekybos dienų skaičiaus.

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

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

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

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

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

13. Pasirinkimo sandoris dėl apsikeitimo sandorio – sutartis, suteikianti savininkui teisę, bet jo neįpareigojanti konkrečią dieną ateityje ar vykdymo dieną arba anksčiau sudaryti apsikeitimo sandorį.

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

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

2. **Obligacijos**

2.1 lentelė

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

Turto klasė – obligacijos (visų rūšių, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas)					
Laikoma, kad kiekvienos atskiros finansinės priemonės rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei ji neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų remiantis kaupiamuoju principu					
Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]				**Dienų, kuriomis prekiauta, procentinė dalis nagrinėjamo laikotarpio atžvilgiu** [3 kiekybinis likvidumo kriterijus]
100 000 EUR	S1	S2	S3	S4	80 %
	15	10	7	2	

2.2 lentelė

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

Turto klasė – obligacijos (visų rūšių, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas)
Laikoma, kad kiekvienos konkrečios obligacijos rinka nėra likvidi pagal 13 straipsnio 18 dalį, jei jai būdingas konkretus obligacijos rūšies ir emisijos dydžio derinys, kaip nurodyta kiekvienoje lentelės eilutėje.

Obligacijų rūšis		**Emisijos dydis**	
Valstybės obligacija	Obligacija, išleista valstybės skolos vertybinių popierių emitento, kuris yra vienas iš šių: a) Sąjunga; b) valstybė narė, įskaitant valstybės Vyriausybės departamentus, įstaigas ar specialiosios paskirties įmones; c) a ir b punktuose nenurodytas valstybės subjektas.	mažiau nei (EUR)	1 000 000 000

<table>
<tr><td colspan="6">Turto klasė – obligacijos (visų rūšių, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas)</td></tr>
<tr><td>Obligacijų rūšis</td><td></td><td colspan="4">Emisijos dydis</td></tr>
<tr><td>Kita valstybės obligacija</td><td>Obligacija, kurią išleido bet kuris iš toliau nurodytų viešųjų emitentų:
a) federacinės valstybės narės atveju – tos federacijos narė;
b) kelių valstybių narių specialiosios paskirties įmonė;
c) tarptautinė finansų įstaiga, įsteigta dviejų ar daugiau valstybių narių, siekiančių sutelkti finansavimą ir teikti finansinę pagalbą savo nariams, kurie patiria ar kuriems gresia rimtos finansinės problemos;
d) Europos investicijų bankas;
e) viešasis subjektas, kuris nėra pirmiau einančioje eilutėje nurodytas valstybės obligacijos emitentas.</td><td colspan="2">mažiau nei (EUR)</td><td colspan="2">500 000 000</td></tr>
<tr><td>Konvertuojamoji obligacija</td><td>Finansinė priemonė, kurią sudaro obligacija ar skolos vertybinis popierius, apimantis išvestinę finansinę priemonę, kaip antai pasirinkimo sandorį dėl pagrindinio nuosavo kapitalo įsigijimo.</td><td colspan="2">mažiau nei (EUR)</td><td colspan="2">500 000 000</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Padengta obligacija</td><td rowspan="2">Obligacija, nurodyta Direktyvos 2009/65/EB 52 straipsnio 4 dalyje.</td><td colspan="2">per S1 ir S2 etapus</td><td colspan="2">per S3 ir S4 etapus</td></tr>
<tr><td>mažiau nei (EUR)</td><td>1 000 000 000</td><td>mažiau nei (EUR)</td><td>500 000 000</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Įmonės obligacija</td><td rowspan="2">Obligacija, kurią išleido pagal Tarybos reglamentą (EB) Nr. 2157/2001 (1) įsteigtos Europos akcinės bendrovės arba Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2009/101/EB (2) 1 straipsnyje nurodytų rūšių bendrovės ar jų atitikmenys trečiosiose šalyse.</td><td colspan="2">per S1 ir S2 etapus</td><td colspan="2">per S3 ir S4 etapus</td></tr>
<tr><td>mažiau nei (EUR)</td><td>1 000 000 000</td><td>mažiau nei (EUR)</td><td>500 000 000</td></tr>
<tr><td>Obligacijų rūšis</td><td colspan="5">Siekiant nustatyti finansines priemones, kurių rinka nėra likvidi pagal 13 straipsnio 18 dalį, taikomi šie metodai</td></tr>
<tr><td>Kita obligacija</td><td colspan="5">Laikoma, kad obligacijų, nepriklausančių nė vienai iš pirmiau nurodytų obligacijų rūšių, rinka nėra likvidi.</td></tr>
</table>

(1) 2001 m. spalio 8 d. Tarybos reglamentas (EB) Nr. 2157/2001 dėl Europos bendrovės (SE) statuto (OL L 294, 2001 11 10, p. 1).
(2) 2009 m. rugsėjo 16 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2009/101/EB dėl apsaugos priemonių, kurių valstybės narės reikalauja iš Sutarties 48 straipsnio antroje pastraipoje apibrėžtų bendrovių siekiant apsaugoti narių ir trečiųjų asmenų interesus, koordinavimo, siekiant suvienodinti tokias apsaugos priemones (OL L 258, 2009 10 1, p. 11).

2.3 lentelė

Obligacijos (visų rūšių, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas) – priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo

Turto klasė – obligacijos (visų rūšių, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas)											
Obligacijų rūšis	**Sandoriai, į kuriuos atsižvelgiama apskaičiuojant ribas atskiroms obligacijų rūšims**	**Procentiliai, taikytini apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo kiekvienai obligacijų rūšiai**								
		Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo					**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
		Sandorio procentilis				**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Sandorio procentilis**
Valstybės obligacija	Įvykdyti sandoriai su valstybės obligacijomis, atmetus 13 straipsnio 10 dalyje nurodytus sandorius.	S1	S2	S3	S4	300 000 EUR	70	300 000 EUR	80	90
		30	40	50	60					
Kita valstybės obligacija	Įvykdyti sandoriai su kitomis valstybės obligacijomis, atmetus 13 straipsnio 10 dalyje nurodytus sandorius.	S1	S2	S3	S4	300 000 EUR	70	300 000 EUR	80	90
		30	40	50	60					
Konvertuojamoji obligacija	Įvykdyti sandoriai su konvertuojamosiomis obligacijomis, atmetus 13 straipsnio 10 dalyje nurodytus sandorius.	S1	S2	S3	S4	200 000 EUR	70	200 000 EUR	80	90
		30	40	50	60					
Padengta obligacija	Įvykdyti sandoriai su padengtomis obligacijomis, atmetus 13 straipsnio 10 dalyje nurodytus sandorius.	S1	S2	S3	S4	300 000 EUR	70	300 000 EUR	80	90
		30	40	40	40					
Įmonės obligacija	Įvykdyti sandoriai su įmonių obligacijomis, atmetus 13 straipsnio 10 dalyje nurodytus sandorius.	S1	S2	S3	S4	200 000 EUR	70	200 000 EUR	80	90
		30	40	50	60					
Kitos obligacijos	Įvykdyti sandoriai su kitomis obligacijomis, atmetus 13 straipsnio 10 dalyje nurodytus sandorius.	S1	S2	S3	S4	200 000 EUR	70	200 000 EUR	80	90
		30	40	50	60					

2.4 lentelė

Obligacijos (biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijų rūšys) – klasės, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – obligacijos (biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijų rūšys)		
Obligacijų rūšis	**Laikoma, kad atskiros finansinės priemonės rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei ji neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų**	
	Dienos apyvartos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
Biržinės prekės Skolos priemonė, išleista emitento tiesioginės investicijos į biržos prekes ar biržos prekių išvestinių priemonių sutartis atžvilgiu. Biržinės prekės kaina yra tiesiogiai ar netiesiogiai susieta su pagrindinės finansinės priemonės rezultatais. Biržinė prekė pasyviai atspindi biržos prekės ar biržos prekių indeksų, su kuriais ji susieta, rezultatus.	500 000 EUR	10
Biržiniai vekseliai Skolos priemonė, išleista emitento tiesioginės investicijos į pagrindinę finansinę priemonę ar pagrindinės finansinės priemonės išvestinių priemonių sutartis atžvilgiu. Biržinio vekselio kaina yra tiesiogiai ar netiesiogiai susieta su pagrindinės finansinės priemonės rezultatais. Biržinis vekselis pasyviai atspindi pagrindinės finansinės priemonės, su kuria jis susietas, rezultatus.	500 000 EUR	10

2.5 lentelė

Obligacijos (biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijų rūšys) – priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo

Turto klasė – obligacijos (biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijų rūšys)				
Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo kiekvienai atskirai priemonei, kurios rinka laikoma likvidžia				
Obligacijų rūšis	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Biržinės prekės	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR	50 000 000 EUR	50 000 000 EUR
Biržiniai vekseliai	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR	50 000 000 EUR	50 000 000 EUR

Turto klasė – obligacijos (biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijų rūšys)				
Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo kiekvienai atskirai priemonei, kurios rinka nėra likvidi				
Obligacijų rūšis	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Biržinės prekės	900 000 EUR	900 000 EUR	45 000 000 EUR	45 000 000 EUR
Biržiniai vekseliai	900 000 EUR	900 000 EUR	45 000 000 EUR	45 000 000 EUR

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

3.1 lentelė

SFP – klasės, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – struktūrizuoti finansiniai produktai (SFP)		
1-asis patikrinimas – SFP turto klasės įvertinimas		
SFP turto klasės įvertinimas, siekiant nustatyti finansines priemones, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą		
Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant su kiekybiniais likvidumo kriterijais susijusias vertes, atliekant SFP turto klasės vertinimą	**SFP turto klasės vertinamos taikant toliau nurodytas kiekybinio likvidumo kriterijų ribas**	
	Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
Įvykdyti sandoriai su visais SFP	300 000 000 EUR	500

2-asis patikrinimas – SFP, kurių rinka nėra likvidi		
Jei abi su kiekybiniais likvidumo kriterijais susijusios vertės viršija kiekybines likvidumo vertes, nustatytas SFP turto klasės įvertinimo tikslais, laikoma, kad 1-ojo patikrinimo rezultatas teigiamas ir turi būti atliktas 2-asis patikrinimas. Laikoma, kad atskiros finansinės priemonės rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei ji neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų.		
Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Dienų, kuriomis prekiauta, procentinė dalis nagrinėjamo laikotarpio atžvilgiu** [3 kiekybinis likvidumo kriterijus]
100 000 EUR	2	80 %

3.2 lentelė

SFP – priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, jei 1-ojo patikrinimo rezultatas neigiamas

Turto klasė – struktūrizuoti finansiniai produktai (SFP)			
Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo visų SFP atžvilgiu, jei 1-ojo patikrinimo rezultatas neigiamas			
Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
100 000 EUR	250 000 EUR	500 000 EUR	1 000 000 EUR

3.3 lentelė

SFP – priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, jei 1-ojo patikrinimo rezultatas teigiamas

Turto klasė – struktūrizuoti finansiniai produktai (SFP)												
Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo visų SFP atžvilgiu, jei 1-ojo patikrinimo rezultatas teigiamas**											
	Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo					**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**		**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**	
	Sandorio procentilis				**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Įvykdyti sandoriai su visais SFP, kurių rinka laikoma likvidžia	S1	S2	S3	S4	100 000 EUR	70	250 000 EUR	80	500 000 EUR	90	1 000 000 EUR
	30	40	50	60							

Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo struktūrizuotiems finansiniams produktams, kurių rinka nėra likvidi, jei 1 patikrinimo rezultatas teigiamas			
Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
100 000 EUR	250 000 EUR	500 000 EUR	1 000 000 EUR

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

4.1 lentelė

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

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

4.2 lentelė

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

Turto klasė – vertybiniais popieriais pakeistos išvestinės finansinės priemonės			
Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo			
Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
50 000 EUR	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

5. **Palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės**

5.1 lentelė

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

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės

Visos Direktyvos 2014/65/ES I priedo C skirsnio 4 punkte apibrėžtos sutartys, kurių galutinė pagrindinė finansinė priemonė yra palūkanų norma, obligacija, paskola, bet koks krepšelis, portfelis ar indeksas, apimantis palūkanų normą, obligaciją, paskolą ar bet kokį kitą produktą, atspindintį palūkanų normos, obligacijos ar paskolos rezultatus.

Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų. Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**
Obligacijų ateities/išankstiniai sandoriai	Obligacijų ateities/išankstinių sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinės priemonės emitentas **2 segmentavimo kriterijus** – pagrindinės pateikiamos obligacijos terminas, apibrėžiamas taip: **trumpas**: pagrindinė pateikiama obligacija, kurios terminas – nuo 1 iki 4 metų, laikoma trumpo termino obligacija **vidutinės trukmės:** pagrindinė pateikiama obligacija, kurios terminas – nuo 4 iki 8 metų, laikoma vidutinės trukmės termino obligacija **ilgas**: pagrindinė pateikiama obligacija, kurios terminas – nuo 8 iki 15 metų, laikoma ilgo termino obligacija **labai ilgas**: pagrindinė pateikiama obligacija, kurios terminas ilgesnis nei 15 metų, laikoma labai ilgo termino obligacija.	5 000 000 EUR	10	Jei poklasis laikomas turinčiu likvidžią rinką konkrečiu laiku iki terminų intervalo, o poklasis, susijęs su vėlesniu laiku iki terminų intervalo, laikomas neturinčiu likvidžios rinkos, pirmoji tolimesnio mėnesio sutartis (angl. *back month contract*) laikoma turinčia likvidžią rinką 2 sav. iki artimesnio mėnesio pabaigos.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės

Turto poklasis	Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, taikomi šie metodai
Kitos palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės Palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės, nepriklausančios nė vienam iš pirmiau išvardytų turto poklasių	Laikoma, kad bet kokių kitų palūkanų normų išvestinių finansinių priemonių rinka nėra likvidi.

5.2 lentelė

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

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės															
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo visiems poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia**														
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**					**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis				**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Obligacijų ateities/ išankstiniai sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Obligacijų pasirinkimo sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Ateities ir išankstiniai palūkanų normų sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	5 000 000 EUR	70	10 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
		30	40	50	60									

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės															
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo visiems poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia**														
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**					**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis				**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Palūkanų normų pasirinkimo sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	5 000 000 EUR	70	10 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo sandorių	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo sandoriai, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos, ir ateities/išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo sandorių, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės															
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo visiems poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia**														
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**					**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis				**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo kintamomis palūkanomis sandoriai ir ateities/išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo kintamomis palūkanomis sandorių	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo fiksuotomis palūkanomis sandoriai ir ateities/išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo fiksuotomis palūkanomis sandorių	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Apsikeitimo palūkanų normomis keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo pagal vienos nakties indeksą sandoriai ir ateities/išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo palūkanų normomis keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo pagal vienos nakties indeksą sandorių	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės														
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo visiems poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia**													
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**					**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis				**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo infliacijos rizika sandoriai ir ateities/išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo infliacijos rizika sandorių	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Apsikeitimo viena valiuta sandoriai, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos, ir ateities/išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo viena valiuta sandorių, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Apsikeitimo viena valiuta kintamomis palūkanomis sandoriai ir ateities/ išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo viena valiuta kintamomis palūkanomis sandorių	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės														
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo visiems poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia**													
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**					**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis				**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Apsikeitimo viena valiuta fiksuotomis palūkanomis sandoriai ir ateities/ išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo viena valiuta fiksuotomis palūkanomis sandorių	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Apsikeitimo palūkanų normomis pagal vienos nakties indeksą viena valiuta sandoriai ir ateities/išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo palūkanų normomis pagal vienos nakties indeksą viena valiuta sandorių	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandoriai ir ateities/išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandorių	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									

5.3 lentelė

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

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės				
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo kiekvienam poklasiui, kurio rinka nėra likvidi**			
	Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Obligacijų ateities/išankstiniai sandoriai	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Obligacijų pasirinkimo sandoriai	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Ateities ir išankstiniai palūkanų normų sandoriai	5 000 000 EUR	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Palūkanų normų pasirinkimo sandoriai	5 000 000 EUR	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo sandorių	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo sandoriai, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos, ir ateities/išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo sandorių, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo kintamomis palūkanomis sandoriai ir ateities/išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo kintamomis palūkanomis sandorių	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo fiksuotomis palūkanomis sandoriai ir ateities/išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo fiksuotomis palūkanomis sandorių	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Apsikeitimo palūkanų normomis keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo pagal vienos nakties indeksą sandoriai ir ateities/išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo palūkanų normomis keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo pagal vienos nakties indeksą sandorių	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo infliacijos rizika sandoriai ir ateities/išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo keliomis valiutomis arba skirtingų valiutų apsikeitimo infliacijos rizika sandorių	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR

Turto klasė – palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės				
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo kiekvienam poklasiui, kurio rinka nėra likvidi**			
	Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Apsikeitimo viena valiuta sandoriai, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos, ir ateities/išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo viena valiuta sandorių, kai vienai šaliai nustatomos fiksuotos, o kitai – kintamos palūkanos	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Apsikeitimo viena valiuta kintamomis palūkanomis sandoriai ir ateities/išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo viena valiuta kintamomis palūkanomis sandorių	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Apsikeitimo viena valiuta fiksuotomis palūkanomis sandoriai ir ateities/išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo viena valiuta fiksuotomis palūkanomis sandorių	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Apsikeitimo palūkanų normomis pagal vienos nakties indeksą viena valiuta sandoriai ir ateities/išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo palūkanų normomis pagal vienos nakties indeksą viena valiuta sandorių	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandoriai ir ateities/išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandorių	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Kitos palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR

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

6.1 lentelė

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

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

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės	
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, taikomi šie metodai**
Akcijų indekso pasirinkimo sandoriai Pasirinkimo sandoris, kurio pagrindinė priemonė yra iš akcijų sudarytas indeksas	Laikoma, kad visų indekso pasirinkimo sandorių rinka yra likvidi.
Akcijų indekso ateities/išankstiniai sandoriai Ateities/išankstinis sandoris, kurio pagrindinė priemonė yra iš akcijų sudarytas indeksas	Laikoma, kad visų indekso ateities/išankstinių sandorių rinka yra likvidi.
Akcijų pasirinkimo sandoriai Pasirinkimo sandoris, kurio pagrindinė priemonė yra akcija ar emitento įvykių nulemtas akcijų krepšelis	Laikoma, kad visų akcijų pasirinkimo sandorių rinka yra likvidi.
Akcijų ateities/išankstiniai sandoriai Ateities/išankstinis sandoris, kurio pagrindinė priemonė yra akcija ar emitento įvykių nulemtas akcijų krepšelis	Laikoma, kad visų akcijų ateities/išankstinių sandorių rinka yra likvidi.
Akcijų dividendų pasirinkimo sandoriai Pasirinkimo sandoris, susijęs su konkrečios akcijos dividendais	Laikoma, kad visų akcijų dividendų pasirinkimo sandorių rinka yra likvidi.
Akcijų dividendų ateities/išankstiniai sandoriai Ateities/išankstinis sandoris, susijęs su konkrečios akcijos dividendais	Laikoma, kad visų akcijų dividendų ateities/išankstinių sandorių rinka yra likvidi.
Dividendų indekso pasirinkimo sandoriai Pasirinkimo sandoris ar indeksas, kurį sudaro daugiau nei vienos akcijos dividendai	Laikoma, kad visų dividendų indekso pasirinkimo sandorių rinka yra likvidi.
Dividendų indekso ateities/išankstiniai sandoriai Ateities/išankstinis sandoris dėl indekso, kurį sudaro daugiau nei vienos akcijos dividendai	Laikoma, kad visų dividendų indekso ateities/išankstinių sandorių rinka yra likvidi.
Kintamumo indekso pasirinkimo sandoriai Pasirinkimo sandoris, kurio pagrindinė priemonė yra kintamumo indeksas, apibrėžiamas kaip indeksas, susijęs su nuosavybės finansinių priemonių konkretaus pagrindinio indekso svyravimu	Laikoma, kad visų kintamumo indekso pasirinkimo sandorių rinka yra likvidi.
Kintamumo indekso ateities/išankstiniai sandoriai Ateities/išankstinis sandoris, kurio pagrindinė priemonė yra kintamumo indeksas, apibrėžiamas kaip indeksas, susijęs su nuosavybės finansinių priemonių konkretaus pagrindinio indekso svyravimu	Laikoma, kad visų kintamumo indekso ateities/išankstinių sandorių rinka yra likvidi.
Biržinių fondų pasirinkimo sandoriai Pasirinkimo sandoris, kurio pagrindinė priemonė – biržinis fondas	Laikoma, kad visų biržinių fondų pasirinkimo sandorių rinka yra likvidi.
Biržinių fondų ateities/išankstiniai sandoriai Ateities/išankstinis sandoris, kurio pagrindinė priemonė – biržinis fondas	Laikoma, kad visų biržinių fondų ateities/išankstinių sandorių rinka yra likvidi.

<table>
<tr><td colspan="5">Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Turto poklasis</td><td colspan="3" rowspan="2">Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau</td><td colspan="2">Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų</td></tr>
<tr><td>Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]</td><td>Sandorių skaičiaus dienos vidurkis [2 kiekybinis likvidumo kriterijus</td></tr>
<tr><td>Apsikeitimo sandoriai</td><td colspan="3">Apsikeitimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus:
1 segmentavimo kriterijus – pagrindinės priemonės rūšis: vienas pavadinimas, indeksas, krepšelis
2 segmentavimo kriterijus – pagrindinė vieno pavadinimo priemonė, indeksas, krepšelis
3 segmentavimo kriterijus – parametras: kainos grąžos pagrindinių rezultatų parametras, grąžos dividendų parametras, grąžos dispersijos parametras, grąžos kintamumo parametras
4 segmentavimo kriterijus – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:</td><td>50 000 000 EUR</td><td>15</td></tr>
<tr><td colspan="4"><table>
<tr><td>Kainos grąžos pagrindinių rezultatų parametras</td><td>Grąžos dispersijos/kintamumo parametras</td><td>Grąžos dividendų parametras</td></tr>
<tr><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn.</td><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn.</td><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td></tr>
<tr><td>2 terminų intervalas: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 mėn.</td><td>2 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn.</td><td>2 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td></tr>
<tr><td>3 terminų intervalas: 3 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn.</td><td>3 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td>3 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai</td></tr>
</table></td></tr>
</table>

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

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės	
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, taikomi šie metodai**
Kitos su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės Su nuosavybės vertybiniais popieriais susieta išvestinė finansinė priemonė, nepriklausanti nė vienam iš pirmiau išvardytų turto poklasių	Laikoma, kad bet kokių kitų su nuosavybės vertybiniais popieriais susietų išvestinių finansinių priemonių rinka nėra likvidi.

6.2 lentelė

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

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės							
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo kiekvienas turto poklasis toliau skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribų vertės iki ir po sandorio sudarymo, nustatytos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, remiantis dienos tariamosios sumos vidurkio intervalu, į kurį poklasis patenka**				
			Dienos tariamosios sumos vidurkis	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
				Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Akcijų indekso pasirinkimo sandoriai	Akcijų indekso pasirinkimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinis akcijų indeksas	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	**< 100 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis**	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 200 mln. EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 600 mln. EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 600 mln. EUR	15 000 000 EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės							
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo kiekvienas turto poklasis toliau skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribų vertės iki ir po sandorio sudarymo, nustatytos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, remiantis dienos tariamosios sumos vidurkio intervalu, į kurį poklasis patenka**				
			Dienos tariamosios sumos vidurkis	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
				Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Akcijų indekso ateities/ išankstiniai sandoriai	Akcijų indekso ateities/išankstinių sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinis akcijų indeksas	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	**< 100 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis**	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 1 mlrd. EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mlrd. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 3 mlrd. EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mlrd. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 5 mlrd. EUR	15 000 000 EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 5 mlrd. EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Akcijų pasirinkimo sandoriai	Akcijų pasirinkimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinė akcija	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	**< 5 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis**	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 10 mln. EUR	250 000 EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 20 mln. EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 20 mln. EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės							
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo kiekvienas turto poklasis toliau skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribų vertės iki ir po sandorio sudarymo, nustatytos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, remiantis dienos tariamosios sumos vidurkio intervalu, į kurį poklasis patenka**				
			Dienos tariamosios sumos vidurkis	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
				Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Akcijų ateities/ išankstiniai sandoriai	Akcijų ateities/išankstinių sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinė akcija	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	**< 5 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis**	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 10 mln. EUR	250 000 EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 20 mln. EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 20 mln. EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
Akcijų dividendų pasirinkimo sandoriai	Akcijų dividendų pasirinkimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinė akcija, suteikianti teisę į dividendus	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	**< 5 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis**	20 000 EUR	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR
			5 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 10 mln. EUR	25 000 EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR
			10 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 20 mln. EUR	50 000 EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 20 mln. EUR	100 000 EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės							
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo kiekvienas turto poklasis toliau skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribų vertės iki ir po sandorio sudarymo, nustatytos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, remiantis dienos tariamosios sumos vidurkio intervalu, į kurį poklasis patenka**				
			Dienos tariamosios sumos vidurkis	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
				Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Akcijų dividendų ateities/ išankstiniai sandoriai	Akcijų dividendų ateities/išankstinių sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinė akcija, suteikianti teisę į dividendus	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	**< 5 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis**	20 000 EUR	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR
			5 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 10 mln. EUR	25 000 EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR
			10 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 20 mln. EUR	50 000 EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 20 mln. EUR	100 000 EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR
Dividendų indekso pasirinkimo sandoriai	Dividendų indekso pasirinkimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinis dividendų indeksas	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	**< 100 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis**	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 200 mln. EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 600 mln. EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 600 mln. EUR	15 000 000 EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės							
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo kiekvienas turto poklasis toliau skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribų vertės iki ir po sandorio sudarymo, nustatytos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, remiantis dienos tariamosios sumos vidurkio intervalu, į kurį poklasis patenka**				
			Dienos tariamosios sumos vidurkis	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
				Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Dividendų indekso ateities/ išankstiniai sandoriai	Dividendų indekso ateities/išankstinių sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinis dividendų indeksas	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	**< 100 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis**	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 1 mlrd. EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mlrd. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 3 mlrd. EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mlrd. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 5 mlrd. EUR	15 000 000 EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 5 mlrd. EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Kintamumo indekso pasirinkimo sandoriai	Kintamumo indekso pasirinkimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinis kintamumo indeksas	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	**< 100 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis**	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 200 mln. EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 600 mln. EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 600 mln. EUR	15 000 000 EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės							
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo kiekvienas turto poklasis toliau skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribų vertės iki ir po sandorio sudarymo, nustatytos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, remiantis dienos tariamosios sumos vidurkio intervalu, į kurį poklasis patenka**				
			Dienos tariamosios sumos vidurkis	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
				Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Kintamumo indekso ateities/išankstiniai sandoriai	Kintamumo indekso ateities/išankstinių sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinis kintamumo indeksas	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	**< 100 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis**	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 1 mlrd. EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mlrd. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 3 mlrd. EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mlrd. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 5 mlrd. EUR	15 000 000 EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 5 mlrd. EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Biržinių fondų pasirinkimo sandoriai	Biržinių fondų pasirinkimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinis biržinis fondas	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	**< 5 mln. EUR dienos tariamosios sumos vidurkis**	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 10 mln. EUR	250 000 EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 20 mln. EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 20 mln. EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

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

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

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

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės								
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo kiekvienas turto poklasis toliau skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**			**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribų vertės iki ir po sandorio sudarymo, nustatytos poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, remiantis dienos tariamosios sumos vidurkio intervalu, į kurį poklasis patenka**			
					Dienos tariamosios sumos vidurkis	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
						Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
	m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai								
Portfelio apsikeitimo sandoriai	Portfelio apsikeitimo sandorių poklasiui būdingas specifinis derinys, kurį sudaro: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinės priemonės rūšis: vienas pavadinimas, indeksas, krepšelis **2 segmentavimo kriterijus** – pagrindinė vieno pavadinimo priemonė, indeksas, krepšelis **3 segmentavimo kriterijus** – parametras: kainos grąžos pagrindinių rezultatų parametras, grąžos dividendų parametras, grąžos dispersijos parametras, grąžos kintamumo parametras **4 segmentavimo kriterijus** – laikotarpis iki portfelio apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:			Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	**50 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 100 mln. EUR**	250 000 EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
					100 mln. EUR ≤ dienos tariamosios sumos vidurkis < 200 mln. EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
					Dienos tariamosios sumos vidurkis ≥ 200 mln. EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
	1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn.								

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

6.3 lentelė

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

Turto klasė – su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės				
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka nėra likvidi**			
	Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Apsikeitimo sandoriai	20 000 EUR	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR
Portfelio apsikeitimo sandoriai	20 000 EUR	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR
Kitos su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės	20 000 EUR	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR

7. **Biržos prekių išvestinės finansinės priemonės**

7.1 lentelė

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

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

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

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

<table>
<tr><th colspan="5">Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Turto poklasis</th><th colspan="3" rowspan="2">Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau</th><th colspan="2">Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų</th></tr>
<tr><th>Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]</th><th>Sandorių skaičiaus dienos vidurkis [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]</th></tr>
<tr><td></td><td colspan="3">4 terminų intervalas: 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … …
m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai
m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>Biržos prekių – energijos ateities/išankstiniai sandoriai</td><td colspan="3">Biržos prekių – energijos ateities/išankstinių sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus:
1 segmentavimo kriterijus – energijos rūšis: nafta, naftos distiliatai, anglys, lengvieji naftos distiliatai, gamtinės dujos, elektra, kelių formų energija
2 segmentavimo kriterijus – pagrindinė energijos prekė
3 segmentavimo kriterijus – tariamosios sumos valiuta, apibrėžiama kaip valiuta, kuria denominuota ateities/išankstinio sandorio tariamoji suma
4 segmentavimo kriterijus – apkrovos tipas: bazinė apkrova, pikinė apkrova, apkrova ne piko metu ir kiti, taikytini elektrai
5 segmentavimo kriterijus – pateikimo (atsiskaitymo grynaisiais) vieta, taikytina visų rūšių energijai: naftai, naftos distiliatams, lengviesiems naftos distiliatams, elektrai, kelių formų energijai
6 segmentavimo kriterijus – laikotarpis iki ateities/išankstinio sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:</td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
<tr><td></td><td>Nafta/naftos distiliatai/lengvieji naftos distiliatai</td><td>Anglys</td><td>Gamtinės dujos/elektra/kelių formų energija</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 4 mėn.</td><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn.</td><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn.</td><td></td><td></td></tr>
</table>

<table>
<tr><th colspan="5">Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės</th></tr>
<tr><th rowspan="2">Turto poklasis</th><th colspan="3" rowspan="2">Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau</th><th colspan="2">Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų</th></tr>
<tr><th>Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]</th><th>Sandorių skaičiaus dienos vidurkis [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]</th></tr>
<tr><td></td><td>2 terminų intervalas: 4 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 8 mėn.</td><td>2 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td>2 terminų intervalas: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td rowspan="5"></td><td rowspan="5"></td></tr>
<tr><td>3 terminų intervalas: 8 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td>3 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td><td>3 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td></tr>
<tr><td>4 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td><td>…</td><td>…</td></tr>
<tr><td>…</td><td>m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai</td><td>m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai</td></tr>
<tr><td>m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>Biržos prekių – energijos pasirinkimo sandoriai</td><td colspan="3">Biržos prekių – energijos pasirinkimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus:
1 segmentavimo kriterijus – energijos rūšis: nafta, naftos distiliatai, anglys, lengvieji naftos distiliatai, gamtinės dujos, elektra, kelių formų energija
2 segmentavimo kriterijus – pagrindinė energijos prekė
3 segmentavimo kriterijus – tariamosios sumos valiuta, apibrėžiama kaip valiuta, kuria denominuota pasirinkimo sandorio tariamoji suma
4 segmentavimo kriterijus – apkrovos tipas: bazinė apkrova, pikinė apkrova, apkrova ne piko metu ir kiti, taikytini elektrai
5 segmentavimo kriterijus – pateikimo (atsiskaitymo grynaisiais) vieta, taikytina visų rūšių energijai: naftai, naftos distiliatams, lengviesiems naftos distiliatams, elektrai, kelių formų energijai
6 segmentavimo kriterijus – laikotarpis iki pasirinkimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:</td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
</table>

<table>
<tr><td colspan="5">Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Turto poklasis</td><td colspan="3" rowspan="2">Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau</td><td>Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų</td></tr>
<tr><td>Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]</td><td>Sandorių skaičiaus dienos vidurkis [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]</td></tr>
<tr><td rowspan="7"></td><td>Nafta/naftos distiliatai/lengvieji naftos distiliatai</td><td>Anglys</td><td>Gamtinės dujos/elektra/kelių formų energija</td><td rowspan="7"></td><td rowspan="7"></td></tr>
<tr><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 4 mėn.</td><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn.</td><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn.</td></tr>
<tr><td>2 terminų intervalas: 4 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 8 mėn.</td><td>2 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td>2 terminų intervalas: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td></tr>
<tr><td>3 terminų intervalas: 8 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td>3 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td><td>3 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td></tr>
<tr><td>4 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td><td>…</td><td>…</td></tr>
<tr><td>…</td><td>m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai</td><td>m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai</td></tr>
<tr><td>m terminų intervalas: (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>Biržos prekių – energijos apsikeitimo sandoriai</td><td colspan="3">Biržos prekių – energijos apsikeitimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus:
1 segmentavimo kriterijus – energijos rūšis: nafta, naftos distiliatai, anglys, lengvieji naftos distiliatai, gamtinės dujos, elektra, kelių formų energija
2 segmentavimo kriterijus – pagrindinė energijos prekė</td><td>10 000 000 EUR</td><td>10</td></tr>
</table>

<table>
<tr><td colspan="5">Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Turto poklasis</td><td colspan="3" rowspan="2">Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau</td><td colspan="2">Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų</td></tr>
<tr><td>Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]</td><td>Sandorių skaičiaus dienos vidurkis [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="3">3 segmentavimo kriterijus – tariamosios sumos valiuta, apibrėžiama kaip valiuta, kuria denominuota apsikeitimo sandorio tariamoji suma
4 segmentavimo kriterijus – atsiskaitymo būdas: grynaisiais, fiziniu turtu ar kt.
5 segmentavimo kriterijus – apkrovos tipas: bazinė apkrova, pikinė apkrova, apkrova ne piko metu ir kiti, taikytini elektrai
6 segmentavimo kriterijus – pateikimo (atsiskaitymo grynaisiais) vieta, taikytina visų rūšių energijai: naftai, naftos distiliatams, lengviesiems naftos distiliatams, elektrai, kelių formų energijai
7 segmentavimo kriterijus – laikotarpis iki apsikeitimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip:
<table>
<tr><th>Nafta/naftos distiliatai/lengvieji naftos distiliatai</th><th>Anglys</th><th>Gamtinės dujos/elektra/kelių formų energija</th></tr>
<tr><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 4 mėn.</td><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn.</td><td>1 terminų intervalas: 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 mėn.</td></tr>
<tr><td>2 terminų intervalas: 4 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 8 mėn.</td><td>2 terminų intervalas: 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td>2 terminų intervalas: 1 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td></tr>
<tr><td>3 terminų intervalas: 8 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai</td><td>3 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td><td>3 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td></tr>
<tr><td>4 terminų intervalas: 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai</td><td>…</td><td>…</td></tr>
</table></td><td></td><td></td></tr>
</table>

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

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

7.2 lentelė

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

Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės															
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka yra likvidi**														
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**					**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**			
		Sandorio procentilis				**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Biržos prekių – metalų ateities/ išankstiniai sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	250 000 EUR	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Biržos prekių – metalų pasirinkimo sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	250 000 EUR	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Biržos prekių – metalų apsikeitimo sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	250 000 EUR	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
		30	40	50	60									

Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės														
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka yra likvidi**													
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**					**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis				**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Biržos prekių – energijos ateities/ išankstiniai sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	250 000 EUR	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Biržos prekių – energijos pasirinkimo sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	250 000 EUR	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Biržos prekių – energijos apsikeitimo sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	250 000 EUR	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
		30	40	50	60									

Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės														
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka yra likvidi**													
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**					**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis				**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Biržos prekių – žemės ūkio produktų ateities/ išankstiniai sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	250 000 EUR	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Biržos prekių – žemės ūkio produktų pasirinkimo sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	250 000 EUR	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Biržos prekių – žemės ūkio produktų apsikeitimo sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	250 000 EUR	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
		30	40	50	60									

7.3 lentelė

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

Turto klasė – biržos prekių išvestinės finansinės priemonės				
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka nėra likvidi**			
	Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Biržos prekių – metalų ateities/išankstiniai sandoriai	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Biržos prekių – metalų pasirinkimo sandoriai	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Biržos prekių – metalų apsikeitimo sandoriai	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Biržos prekių – energijos ateities/išankstiniai sandoriai	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Biržos prekių – energijos pasirinkimo sandoriai	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Biržos prekių – energijos apsikeitimo sandoriai	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Biržos prekių – žemės ūkio produktų ateities/išankstiniai sandoriai	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Biržos prekių – žemės ūkio produktų pasirinkimo sandoriai	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Biržos prekių – žemės ūkio produktų apsikeitimo sandoriai	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Kitų biržos prekių išvestinės finansinės priemonės	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR

8. **Užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės**

8.1 lentelė

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

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

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

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

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

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

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

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

Turto klasė – užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės	
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, taikomi šie metodai**
Kitos užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės Užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės, nepriklausančios nė vienam iš pirmiau išvardytų turto poklasių	Laikoma, kad kitų užsienio valiutos išvestinių finansinių priemonių rinka nėra likvidi.

8.2 lentelė

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

Turto klasė – užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės				
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka nėra likvidi**			
	Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Išankstiniai sandoriai be apsikeitimo pagrindine suma	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Išankstiniai sandoriai su apsikeitimu pagrindine suma	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Užsienio valiutos pasirinkimo sandoriai be apsikeitimo pagrindine suma	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Užsienio valiutos pasirinkimo sandoriai su apsikeitimu pagrindine suma	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Užsienio valiutos apsikeitimo sandoriai be apsikeitimo pagrindine suma	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Užsienio valiutos apsikeitimo sandoriai su apsikeitimu pagrindine suma	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Užsienio valiutos ateities sandoriai	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Kitos užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR

9. **Kredito išvestinės finansinės priemonės**

9.1 lentelė

Kredito išvestinės finansinės priemonės – klasės, kurių rinka nėra likvidi

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

Turto klasė – kredito išvestinės finansinės priemonės				
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų. Poklasiams, kurių rinka laikoma likvidžia, atitinkamais atvejais taikomi papildomi kokybiniai likvidumo kriterijai**		
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Aktualiausios indekso versijos statusas** [Papildomas kokybinis likvidumo kriterijus]
Vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriai Apsikeitimo sandoriai, pagal kuriuos vykdomas apsikeitimas pinigų srautais siejamas su vieno emitento, leidžiančio finansines priemones, kreditingumu ir kredito įvykių įvykimu	Vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų nevykdymo apsikeitimo sandorių poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – pagrindinis referencinis subjektas **2 segmentavimo kriterijus** – pagrindinio referencinio subjekto tipas, apibrėžtas taip: valstybinio ir viešojo tipo emitentas – vienas iš toliau išvardytų emisiją vykdančių subjektų: a) Sąjunga; b) valstybė narė, įskaitant valstybės narės Vyriausybės departamentus, įstaigas ar specialiosios paskirties įmones; c) a ir b punktuose nenurodytas valstybės subjektas; d) federacinės valstybės narės atveju – federacijos narė; e) kelių valstybių narių specialiosios paskirties įmonė; f) tarptautinė finansų įstaiga, įsteigta dviejų ar daugiau valstybių narių, siekiančių sutelkti finansavimą ir suteikti finansinę pagalbą savo nariams, kurie patiria ar kuriems gresia rimtos finansinės problemos; g) Europos investicijų bankas; h) viešasis subjektas, kuris nėra a–c punktuose nurodytas valstybės skolos vertybinių popierių emitentas; įmonių tipo emitentas – emitentas, kuris nėra valstybinio ir viešojo tipo emitentas. **3 segmentavimo kriterijus** – tariamosios sumos valiuta, apibrėžiama kaip valiuta, kuria denominuota išvestinės finansinės priemonės tariamoji suma **4 segmentavimo kriterijus** – laikotarpis iki kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių terminų intervalo apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas:** 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **2 terminų intervalas:** 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai **3 terminų intervalas:** 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … **m terminų intervalas:** (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	10 000 000 EUR	10	

Turto klasė – kredito išvestinės finansinės priemonės		
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka toliau nurodyto kiekybinio likvidumo kriterijaus**
Pasirinkimo sandoriai, susiję su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu Pasirinkimo sandoris, kurio pagrindinė priemonė yra kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksas	Pasirinkimo sandorių, susijusių su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indekso poklasis, nustatytas į indeksą įtrauktų kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių poklasiui **2 segmentavimo kriterijus** – laikotarpis iki pasirinkimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas:** 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. **2 terminų intervalas:** 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **3 terminų intervalas:** 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai **4 terminų intervalas:** 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … **m terminų intervalas:** (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	Pasirinkimo sandorio, susijusio su pagrindiniu kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, priklausančiu poklasiui, kurio rinka laikoma likvidžia ir kurio laikotarpis iki terminų intervalo yra 0–6 mėn., rinka yra likvidi; pasirinkimo sandorio, susijusio su pagrindiniu kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, priklausančiu poklasiui, kurio rinka laikoma likvidžia ir kurio laikotarpis iki terminų intervalo nėra 0–6 mėn., rinka nėra likvidi; pasirinkimo sandorio, susijusio su pagrindiniu kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, priklausančiu poklasiui, kurio rinka laikoma nelikvidžia, rinka nėra likvidi jokiu metu iki terminų intervalo.
Pasirinkimo sandoriai, susiję su vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriais Pasirinkimo sandoris, kurio pagrindinė priemonė yra vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	Pasirinkimo sandorių, susijusių su vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriais, poklasis apibrėžiamas pagal šiuos segmentavimo kriterijus: **1 segmentavimo kriterijus** – vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorio poklasis, nustatytas vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorio turto poklasiui **2 segmentavimo kriterijus** – laikotarpis iki pasirinkimo sandorio terminų intervalo, apibrėžiamas taip: **1 terminų intervalas:** 0 < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 6 mėn. **2 terminų intervalas:** 6 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **3 terminų intervalas:** 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai **4 terminų intervalas:** 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … **m terminų intervalas:** (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai	pasirinkimo sandorio, susijusio su vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriais, kurio pagrindinis vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris priklauso poklasiui, kurio rinka laikoma likvidžia ir kurio laikotarpis iki terminų intervalo yra 0–6 mėn., rinka yra likvidi; pasirinkimo sandorio, susijusio su vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriais, kurio pagrindinis vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris priklauso poklasiui, kurio rinka laikoma likvidžia ir kurio laikotarpis iki terminų intervalo nėra 0–6 mėn., rinka nėra likvidi; pasirinkimo sandorio, susijusio su vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriais, kurio pagrindinis vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris priklauso poklasiui, kurio rinka laikoma nelikvidžia, rinka nėra likvidi jokiu metu iki terminų intervalo.

Turto klasė – kredito išvestinės finansinės priemonės	
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti, kokių finansinių priemonių klasių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, šie tokie metodai**
Kitos kredito išvestinės finansinės priemonės Kredito išvestinė finansinė priemonė, nepriklausanti nė vienam iš pirmiau išvardytų turto poklasių	Laikoma, kad kitų kredito išvestinių finansinių priemonių rinka nėra likvidi.

9.2 lentelė

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

Turto klasė – kredito išvestinės finansinės priemonės														
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka yra likvidi**													
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**					**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis				**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Į indeksą įtrauktas kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	2 500 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	2 500 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Į individualizuotą krepšelį įtrauktas kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	2 500 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									

Turto klasė – kredito išvestinės finansinės priemonės														
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka yra likvidi**													
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**					**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis				**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Pasirinkimo sandoriai, susiję su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	2 500 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriai	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	2 500 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									

9.3 lentelė

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

Turto klasė – kredito išvestinės finansinės priemonės				
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka nėra likvidi**			
	Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Į indeksą įtrauktas kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Į individualizuotą krepšelį įtrauktas kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoris	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Pasirinkimo sandoriai, susiję su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriai	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Kitos kredito išvestinės finansinės priemonės	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR

10. **C10 išvestinės finansinės priemonės**

10.1 lentelė

C10 išvestinės finansinės priemonės– klasės, kurių rinka nėra likvidi

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

Turto klasė – C10 išvestinės finansinės priemonės			
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų**	
		Dienos tariamosios sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
	5 terminų intervalas: 9 mėn. < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 1 metai **6 terminų intervalas:** 1 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 2 metai **7 terminų intervalas:** 2 metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ 3 metai … **m terminų intervalas:** (n-1) metai < laikotarpis iki termino pabaigos ≤ n metai		

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

10.2 lentelė

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

Turto klasė – C10 išvestinės finansinės priemonės															
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka yra likvidi**														
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**					**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis				**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Frachto išvestinės finansinės priemonės	Ribų skaičiavimas turėtų būti atliekamas kiekvieno poklasio, įeinančio į turto poklasį, atžvilgiu atsižvelgiant į įvykdytus sandorius su tam poklasiui priklausančiomis finansinėmis priemonėmis.	S1	S2	S3	S4	25 000 EUR	70	50 000 EUR	80	60	75 000 EUR	90	70	100 000 EUR
		30	40	50	60									

10.3 lentelė

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

Turto klasė – C10 išvestinės finansinės priemonės				
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka nėra likvidi**			
	Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Frachto išvestinės finansinės priemonės	25 000 EUR	50 000 EUR	75 000 EUR	100 000 EUR
Kitos C10 išvestinės finansinės priemonės	25 000 EUR	50 000 EUR	75 000 EUR	100 000 EUR

11. **Finansiniai sandoriai dėl kainų skirtumo**

11.1 lentelė

Sandoriai dėl kainų skirtumo – klasės, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – finansiniai sandoriai dėl kainų skirtumo

Išvestinės finansinės priemonės susitarimas, pagal kurio sąlygas turėtojas įgyja ilgąją arba trumpąją poziciją, susijusią su pagrindinio turto kainos susitarimo galiojimo pradžioje ir jo kainos susitarimui pasibaigus skirtumu.

Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų arba jei atitinkamais atvejais jis neatitinka toliau nurodyto kokybinio likvidumo kriterijaus**		
		Kokybinis likvidumo kriterijus	**Dienos tariamosios sumos vidurkis** [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
Valiutos sandoriai dėl kainų skirtumo	Valiutos sandorių dėl kainų skirtumo poklasis apibrėžiamas pagal pagrindinių valiutų porą, kuri apibrėžiama kaip sandorių dėl kainų skirtumo ar kainų skirtumų lažybų sandorio dviejų pagrindinių valiutų derinys.		50 000 000 EUR	100
Biržos prekių sandoriai dėl kainų skirtumo	Biržos prekių sandorių dėl kainų skirtumo poklasis apibrėžiamas pagal sandorių dėl kainų skirtumo ar kainų skirtumų lažybų pagrindinę biržos prekę.		50 000 000 EUR	100
Nuosavybės vertybinių popierių sandoriai dėl kainų skirtumo	Nuosavybės vertybinių popierių sandorių dėl kainų skirtumo poklasis apibrėžiamas pagal sandorių dėl kainų skirtumo ar kainų skirtumų lažybų sandorio pagrindinį nuosavybės vertybinį popierių.	Nuosavybės vertybinių popierių sandorių dėl kainų skirtumo rinka laikoma likvidžia, jei pagrindinė priemonė yra nuosavybės vertybinis popierius, kurio rinka yra likvidi, kaip nustatyta remiantis Reglamento (ES) Nr. 600/2014 2 straipsnio 1 dalies 17 punkto b papunkčiu.		
Obligacijų sandoriai dėl kainų skirtumo	Obligacijų sandorių dėl kainų skirtumo poklasis apibrėžiamas pagal sandorių dėl kainų skirtumo ar kainų skirtumų lažybų sandorio pagrindinę obligaciją ar obligacijų ateities sandorį.	Obligacijų sandorių dėl kainų skirtumo rinka laikoma likvidžia, jei pagrindinė priemonė yra obligacija ar obligacijų ateities sandoris, kurių rinka yra likvidi, kaip nustatyta remiantis 6 straipsniu ir 8 straipsnio 1 dalies b punktu.		

Turto klasė – finansiniai sandoriai dėl kainų skirtumo				
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, kiekvienas turto poklasis papildomai skaidomas į poklasius, kaip nurodyta toliau**	**Laikoma, kad poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų arba jei atitinkamais atvejais jis neatitinka toliau nurodyto kokybinio likvidumo kriterijaus**		
		Kokybinis likvidumo kriterijus	**Dienos tariamosios sumos vidurkis** [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
Sandoriai dėl kainų skirtumo, susiję su nuosavybės vertybinių popierių ateities/išankstiniais sandoriais	Sandorių dėl kainų skirtumo, susijusių su nuosavybės vertybinių popierių ateities/išankstiniais sandoriais, poklasis apibrėžiamas pagal pagrindinį ateities/išankstinį sandorį, susijusį su sandorių dėl kainų skirtumo ar kainų skirtumų lažybų nuosavybės vertybiniu popieriumi.	Laikoma, kad sandorių dėl kainų skirtumo, susijusių su nuosavybės vertybinių popierių ateities/išankstiniais sandoriais, rinka yra likvidi, jei pagrindinė priemonė yra nuosavybės vertybinių popierių ateities/išankstinis sandoris, kurio rinka yra likvidi, kaip nustatyta remiantis 6 straipsniu ir 8 straipsnio 1 dalies b punktu.		
Sandoriai dėl kainų skirtumo, susiję su nuosavybės vertybinių popierių pasirinkimo sandoriais	Sandorių dėl kainų skirtumo, susijusių su nuosavybės vertybinių popierių pasirinkimo sandoriais, poklasis apibrėžiamas pagal pagrindinį pasirinkimo sandorį, susijusį su sandorių dėl kainų skirtumo ar kainų skirtumų lažybų nuosavybės vertybiniu popieriumi.	Laikoma, kad sandorių dėl kainų skirtumo, susijusių su nuosavybės vertybinių popierių pasirinkimo sandoriais, rinka yra likvidi, jei pagrindinė priemonė yra nuosavybės vertybinių popierių pasirinkimo sandoris, kurio rinka yra likvidi, kaip nustatyta remiantis 6 straipsniu ir 8 straipsnio 1 dalies b punktu.		

Turto klasė – finansiniai sandoriai dėl kainų skirtumo	
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, taikomi šie metodai**
Kiti sandoriai dėl kainų skirtumo	
Sandoris dėl kainų skirtumo ar kainų skirtumų lažybos, nepriklausantys nė vienam iš pirmiau išvardytų turto poklasių	Laikoma, kad kitų sandorių dėl kainų skirtumo ar kainų skirtumų lažybų rinka nėra likvidi.

11.2 lentelė

Sandoriai dėl kainų skirtumo – priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos poklasiams, kurių rinka yra likvidi

Turto klasė – finansiniai sandoriai dėl kainų skirtumo															
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka yra likvidi**														
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**					**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**			
		Sandorio procentilis				**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	
Valiutos sandoriai dėl kainų skirtumo	Įvykdyti sandoriai, susiję su valiutos sandoriais dėl kainų skirtumo, kurių rinka laikoma likvidžia pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą.	S1	S2	S3	S4	50 000 EUR	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR	
		30	40	50	60										
Biržos prekių sandoriai dėl kainų skirtumo	Įvykdyti sandoriai, susiję su biržos prekių sandoriais dėl kainų skirtumo, kurių rinka laikoma likvidžia pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą.	S1	S2	S3	S4	50 000 EUR	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR	
		30	40	50	60										
Nuosavybės vertybinių popierių sandoriai dėl kainų skirtumo	Įvykdyti sandoriai, susiję su nuosavybės vertybinių popierių sandoriais dėl kainų skirtumo, kurių rinka laikoma likvidžia pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą.	S1	S2	S3	S4	50 000 EUR	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR	
		30	40	50	60										

Turto klasė – finansiniai sandoriai dėl kainų skirtumo														
Turto poklasis	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka yra likvidi**													
	Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas	**Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo**					**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**			**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**		
		Sandorio procentilis				**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Apimties procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Obligacijų sandoriai dėl kainų skirtumo	Įvykdyti sandoriai, susiję su obligacijų sandoriais dėl kainų skirtumo, kurių rinka laikoma likvidžia pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą.	S1	S2	S3	S4	50 000 EUR	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
		30	40	50	60									
Sandoriai dėl kainų skirtumo, susiję su nuosavybės vertybinių popierių ateities/išankstiniais sandoriais	Įvykdyti sandoriai dėl kainų skirtumo, susiję su ateities sandoriais dėl nuosavybės vertybinio popieriaus, kurio rinka laikoma likvidžia pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą.	S1	S2	S3	S4	50 000 EUR	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
		30	40	50	60									
Sandoriai dėl kainų skirtumo, susiję su nuosavybės vertybinių popierių pasirinkimo sandoriais	Įvykdyti sandoriai dėl kainų skirtumo, susiję su pasirinkimo sandoriais dėl nuosavybės vertybinio popieriaus, kurio rinka laikoma likvidžia pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą.	S1	S2	S3	S4	50 000 EUR	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
		30	40	50	60									

11.3 lentelė

Sandoriai dėl kainų skirtumo – priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos poklasiams, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – finansiniai sandoriai dėl kainų skirtumo				
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka nėra likvidi**			
	Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Valiutos sandoriai dėl kainų skirtumo	50 000 EUR	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Biržos prekių sandoriai dėl kainų skirtumo	50 000 EUR	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Nuosavybės vertybinių popierių sandoriai dėl kainų skirtumo	50 000 EUR	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Obligacijų sandoriai dėl kainų skirtumo	50 000 EUR	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Sandoriai dėl kainų skirtumo, susiję su nuosavybės vertybinių popierių ateities/išankstiniais sandoriais	50 000 EUR	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Sandoriai dėl kainų skirtumo, susiję su nuosavybės vertybinių popierių pasirinkimo sandoriais	50 000 EUR	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Kiti sandoriai dėl kainų skirtumo/kainų skirtumų lažybos	50 000 EUR	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

12. **Apyvartiniai taršos leidimai**

12.1 lentelė

Apyvartiniai taršos leidimai – klasės, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – apyvartiniai taršos leidimai		
Turto poklasis	**Laikoma, kad turto poklasio rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, jei poklasis neatitinka vienos ar visų iš toliau nurodytų kiekybinių likvidumo kriterijų ribų**	
	Dienos sumos vidurkis [1 kiekybinis likvidumo kriterijus]	**Sandorių skaičiaus dienos vidurkis** [2 kiekybinis likvidumo kriterijus]
Europos Sąjungos apyvartiniai taršos leidimai (EUA) Bet koks vienetas, pripažintas atitinkančiu Europos Parlamento ir Tarybos direktyvos 2003/87/EB [1] (dėl apyvartinių taršos leidimų prekybos sistemos) reikalavimus ir suteikiantis teisę išmesti vienos anglies dioksido tonos ekvivalentą (tCO_2e).	150 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	5
Europos Sąjungos aviacijos apyvartiniai taršos leidimai (EUAA) Bet koks vienetas, pripažintas atitinkančiu Direktyvos 2003/87/EB (dėl apyvartinių taršos leidimų prekybos sistemos) reikalavimus ir suteikiantis teisę išmesti vienos anglies dioksido tonos ekvivalentą (tCO_2e) aviacijos sektoriuje.	150 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	5
Patvirtinti išmetamųjų teršalų mažinimo vienetai (CER) Bet koks vienetas, pripažintas atitinkančiu Direktyvos 2003/87/EB (dėl apyvartinių taršos leidimų prekybos sistemos) reikalavimus ir lygus išmetamųjų teršalų mažinimo ekvivalentui, atitinkančiam vienos anglies dioksido tonos ekvivalentą (tCO_2e).	150 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	5
Išmetamųjų teršalų mažinimo vienetai (ERU) Bet koks vienetas, pripažintas atitinkančiu Direktyvos 2003/87/EB (dėl apyvartinių taršos leidimų prekybos sistemos) reikalavimus ir lygus išmetamųjų teršalų mažinimo ekvivalentui, atitinkančiam vienos anglies dioksido tonos ekvivalentą (tCO_2e).	150 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	5

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

12.2 lentelė

Apyvartiniai taršos leidimai – priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos turto poklasiams, kurių rinka yra likvidi

Turto klasė – apyvartiniai taršos leidimai													
Turto poklasis	**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo turto poklasiams, kurių rinka yra likvidi**											
		Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo					**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**		**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**	
		Sandorio procentilis				**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Europos Sąjungos apyvartiniai taršos leidimai (EUA)	Įvykdyti sandoriai su visais Europos Sąjungos apyvartiniais taršos leidimais (EUA).	S1	S2	S3	S4	40 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	70	50 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	80	90 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	90	100 000 tonų anglies dioksido ekvivalento
		30	40	50	60							
Europos Sąjungos aviacijos apyvartiniai taršos leidimai (EUAA)	Įvykdyti sandoriai su visais Europos Sąjungos aviacijos apyvartiniais taršos leidimais (EUA).	S1	S2	S3	S4	20 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	70	25 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	80	40 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	90	50 000 tonų anglies dioksido ekvivalento
		30	40	50	60							
Patvirtinti išmetamųjų teršalų mažinimo vienetai (CER)	Įvykdyti sandoriai su visais patvirtintais išmetamųjų teršalų mažinimo vienetais (CER).	S1	S2	S3	S4	20 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	70	25 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	80	40 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	90	50 000 tonų anglies dioksido ekvivalento
		30	40	50	60							
Išmetamųjų teršalų mažinimo vienetai (ERU)	Įvykdyti sandoriai su visais išmetamųjų teršalų mažinimo vienetais (ERU).	S1	S2	S3	S4	20 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	70	25 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	80	40 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	90	50 000 tonų anglies dioksido ekvivalento
		30	40	50	60							

12.3 lentelė

Apyvartiniai taršos leidimai – priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo, taikytinos turto poklasiams, kurių rinka nėra likvidi

Turto klasė – apyvartiniai taršos leidimai				
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo poklasiams, kurių rinka nėra likvidi**			
	Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Europos Sąjungos apyvartiniai taršos leidimai (EUA)	40 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	50 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	90 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	100 000 tonų anglies dioksido ekvivalento
Europos Sąjungos aviacijos apyvartiniai taršos leidimai (EUAA)	20 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	25 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	40 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	50 000 tonų anglies dioksido ekvivalento
Patvirtinti išmetamųjų teršalų mažinimo vienetai (CER)	20 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	25 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	40 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	50 000 tonų anglies dioksido ekvivalento
Išmetamųjų teršalų mažinimo vienetai (ERU)	20 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	25 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	40 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	50 000 tonų anglies dioksido ekvivalento

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

13.1 lentelė

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

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

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

Turto klasė – apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės	
Turto poklasis	**Siekiant nustatyti finansinių priemonių klases, kurių rinka nėra likvidi pagal 6 straipsnį ir 8 straipsnio 1 dalies b punktą, taikomi šie metodai**
Kitos apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė nėra Europos Sąjungos apyvartiniai taršos leidimai (EUA), Europos Sąjungos aviacijos apyvartiniai taršos leidimai (EUAA), patvirtinti išmetamųjų teršalų mažinimo vienetai (CER) ar išmetamųjų teršalų mažinimo vienetai (ERU).	Laikoma, kad kitų apyvartinių taršos leidimų išvestinių finansinių priemonių rinka nėra likvidi.

13.2 lentelė

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

Turto klasė – apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės													
Turto poklasis	**Sandoriai, į kuriuos reikia atsižvelgti apskaičiuojant ribas**	**Procentiliai ir minimalios ribinės vertės, taikytinos apskaičiuojant priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribas iki ir po sandorio sudarymo turto poklasiams, kurių rinka yra likvidi**											
		Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo					**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**		**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**		**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**	
		Sandorio procentilis				**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**	**Sandorio procentilis**	**Minimali ribinė vertė**
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra Europos Sąjungos apyvartinių taršos leidimų (EUA) tipo	Įvykdyti sandoriai su visomis apyvartinių taršos leidimų išvestinėmis finansinėmis priemonėmis, kurių pagrindinė priemonė yra Europos Sąjungos apyvartinių taršos leidimų (EUA) tipo.	S1	S2	S3	S4	40 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	70	50 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	80	90 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	90	100 000 tonų anglies dioksido ekvivalento
		30	40	50	60							
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra Europos Sąjungos aviacijos apyvartinių taršos leidimų (EUAA) tipo	Įvykdyti sandoriai su visomis apyvartinių taršos leidimų išvestinėmis finansinėmis priemonėmis, kurių pagrindinė priemonė yra Europos Sąjungos aviacijos apyvartinių leidimų (EUAA) tipo.	S1	S2	S3	S4	20 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	70	25 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	80	40 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	90	50 000 tonų anglies dioksido ekvivalento
		30	40	50	60							
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra patvirtintų išmetamųjų teršalų mažinimo vienetų (CER) tipo	Įvykdyti sandoriai su visomis apyvartinių taršos leidimų išvestinėmis finansinėmis priemonėmis, kurių pagrindinė priemonė yra patvirtintų išmetamųjų teršalų mažinimo vienetų (CER) tipo.	S1	S2	S3	S4	20 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	70	25 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	80	40 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	90	50 000 tonų anglies dioksido ekvivalento
		30	40	50	60							
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra išmetamųjų teršalų mažinimo vienetų (ERU) tipo	Įvykdyti sandoriai su visomis apyvartinių taršos leidimų išvestinėmis finansinėmis priemonėmis, kurių pagrindinė priemonė yra išmetamųjų teršalų mažinimo vienetų (ERU) tipo.	S1	S2	S3	S4	20 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	70	25 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	80	40 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	90	50 000 tonų anglies dioksido ekvivalento
		30	40	50	60							

13.3 lentelė

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

Turto klasė – apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės				
Turto poklasis	**Priemonei būdingo dydžio ir didelės apimties ribos iki ir po sandorio sudarymo turto poklasiams, kurių rinka nėra likvidi**			
	Priemonei būdingas dydis iki sandorio sudarymo	**Didelės apimties dydis iki sandorio sudarymo**	**Priemonei būdingas dydis po sandorio sudarymo**	**Didelės apimties dydis po sandorio sudarymo**
	Ribinė vertė	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**	**Ribinė vertė**
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra Europos Sąjungos apyvartinių taršos leidimų (EUA) tipo	40 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	50 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	90 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	100 000 tonų anglies dioksido ekvivalento
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra Europos Sąjungos aviacijos apyvartinių taršos leidimų (EUAA) tipo	20 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	25 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	40 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	50 000 tonų anglies dioksido ekvivalento
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra patvirtintų išmetamųjų teršalų mažinimo vienetų (CER) tipo	20 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	25 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	40 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	50 000 tonų anglies dioksido ekvivalento
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės, kurių pagrindinė priemonė yra išmetamųjų teršalų mažinimo vienetų (ERU) tipo	20 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	25 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	40 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	50 000 tonų anglies dioksido ekvivalento
Kitos apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės	20 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	25 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	40 000 tonų anglies dioksido ekvivalento	50 000 tonų anglies dioksido ekvivalento

IV PRIEDAS

Baziniai duomenys, pateiktini su skaidrumu susijusiems skaičiavimams atlikti

1 lentelė

2 lentelės simbolių lentelė

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

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

2 lentelė

Informacija apie bazinius duomenis, pateiktinus su skaidrumu susijusiems skaičiavimams atlikti

#	LAUKELIS	IŠSAMI INFORMACIJA, KURIĄ REIKIA PATEIKTI	ATASKAITŲ TEIKIMO FORMA
1	Priemonės identifikavimo kodas	Finansinei priemonei identifikuoti naudojamas kodas	{ISIN}
2	Nesutrumpintas priemonės pavadinimas	Nesutrumpintas finansinės priemonės pavadinimas.	{ALPHANUM-350}
3	FPRR identifikatorius	**Ne nuosavo kapitalo finansinių priemonių identifikavimas:** **Vertybiniais popieriais pakeistos išvestinės finansinės priemonės**, kaip apibrėžta III priedo 4 skirsnio 4.1 lentelėje **Struktūrizuoti finansiniai produktai (SFP)**, kaip apibrėžta Reglamento (ES) Nr. 600/2014 2 straipsnio 1 dalies 28 punkte **Obligacijos** (visoms obligacijoms, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas), kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES 4 straipsnio 1 dalies 44 punkto b papunktyje **Biržinės prekės**, kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES 4 straipsnio 1 dalies 44 punkto b papunktyje ir patikslinta III priedo 2 skirsnio 2.4 lentelėje **Biržiniai vekseliai**, kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES 4 straipsnio 1 dalies 44 punkto b papunktyje ir patikslinta III priedo 2 skirsnio 2.4 lentelėje **Apyvartiniai taršos leidimai**, kaip apibrėžta III priedo 12 skirsnio 12.1 lentelėje **Išvestinės finansinės priemonės**, kaip apibrėžta Direktyvos 2014/65/ES I priedo C skirsnio 4–10 punktuose	**Ne nuosavo kapitalo finansinės priemonės:** SDRV – vertybiniais popieriais pakeistos išvestinės finansinės priemonės SFPS – struktūrizuoti finansiniai produktai (SFP) BOND – obligacijos ETCS – biržinės prekės ETNS – biržiniai vekseliai EMAL – apyvartiniai taršos leidimai DERV – išvestinės finansinės priemonės
4	Pagrindinės priemonės turto klasė	Pildytina, kai FPRR identifikavimo kodas žymi vertybiniais popieriais pakeistą išvestinę finansinę priemonę arba išvestinę finansinę priemonę.	INTR – palūkanų norma EQUI – nuosavybės vertybinis popierius COMM – biržos prekė CRDT – kreditas CURR – valiuta EMAL – apyvartiniai taršos leidimai

#	LAUKELIS	IŠSAMI INFORMACIJA, KURIĄ REIKIA PATEIKTI	ATASKAITŲ TEIKIMO FORMA
5	Sutarties tipas	Pildytina, kai FPRR identifikavimo kodas žymi išvestinę finansinę priemonę.	OPTN – pasirinkimo sandoriai FUTR – ateities sandoriai FRAS – išankstiniai palūkanų normų susitarimai FORW – išankstiniai sandoriai SWAP – apsikeitimo sandoriai PSWP – portfelio apsikeitimo sandoriai SWPT – pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo sandorių FONS – ateities sandoriai dėl apsikeitimo sandorio FWOS – išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo sandorio FFAS – išankstiniai frachto susitarimai SPDB – kainų skirtumų lažybos CFDS – sandoriai dėl kainų skirtumo OTHR – kita
6	Informacijos teikimo diena	Diena, kurios baziniai duomenys pateikiami	{DATEFORMAT}
7	Prekybos vieta	Prekybos vietos segmento rinkos identifikavimo kodas (MIC), kai yra, kitu atveju – veiklos MIC.	{MIC}
8	Terminas	Finansinės priemonės terminas. Laukelis, skirtas obligacijų, palūkanų normų išvestinių finansinių priemonių, su nuosavybės vertybiniais popieriais susietų išvestinių finansinių priemonių, biržos prekių išvestinių finansinių priemonių, užsienio valiutos keitimo išvestinių finansinių priemonių, kredito išvestinių finansinių priemonių, C10 išvestinių finansinių priemonių ir apyvartinių taršos leidimų išvestinių finansinių priemonių turto poklasiams.	{DATEFORMAT}
Laukeliai, susiję su obligacijomis (visų rūšių, išskyrus biržinių prekių ir biržinių vekselių obligacijas)			
9	Obligacijų rūšis	Obligacijų rūšis, kaip apibrėžta III priedo 2 skirsnio 2.2 lentelėje. Pildytina, kai FPRR identifikavimo kodu žymimos obligacijos.	EUSB – valstybės obligacijos OEPB – kitos viešosios obligacijos CVTB – konvertuojamosios obligacijos CVDB – padengtos obligacijos CRPB – įmonių obligacijos OTHR – kita
10	Emisijos data	Data, kurią obligacija išleidžiama ir pradedamos skaičiuoti palūkanos.	{DATEFORMAT}
Su apyvartiniais taršos leidimais susiję laukeliai			
Į šio skirsnio laukelius turėtų būti įrašomi tik apyvartinių taršos leidimų, kaip apibrėžta III priedo 12 skirsnio 12.1 lentelėje. duomenys.			
11	Apyvartinių taršos leidimų porūšis	Apyvartiniai taršos leidimai	CERE – CER ERUE – ERU EUAE – EUA EUAA – CER

#	LAUKELIS	IŠSAMI INFORMACIJA, KURIĄ REIKIA PATEIKTI	ATASKAITŲ TEIKIMO FORMA
Su išvestinėmis finansinėmis priemonėmis susiję laukeliai			
Biržos prekių išvestinės finansinės priemonės ir C10 išvestinės finansinės priemonės			
12	Dydžio nurodymas pagal frachto porūšį	Pildytina, jei Deleguotojo reglamento (ES) 2017/585 priedo 2 lentelės 35 laukelyje nurodyta bazinė prekė yra frachtas.	{ALPHANUM-25}
13	Konkretus maršrutas arba laivo frachtavimo tam tikram laikui vidurkis	Pildytina, jei Deleguotojo reglamento (ES) 2017/585 2 lentelės 35 laukelyje nurodyta bazinė prekė yra frachtas.	{ALPHANUM-25}
14	Pateikimo/atsiskaitymo grynaisiais vieta	Pildytina, jei Deleguotojo reglamento (ES) 2017/585 2 lentelės 35 laukelyje nurodyta bazinė prekė yra energija.	{ALPHANUM-25}
15	Tariamosios sumos valiuta	Valiuta, kuria denominuota tariamoji suma	{CURRENCYCODE_3}
Palūkanų normų išvestinės finansinės priemonės			
Šio skirsnio laukeliai turėtų būti pildomi tik palūkanų normų išvestinių finansinių priemonių, kaip apibrėžta III priedo 5 skirsnio 5.1 lentelėje, duomenimis.			
16	Pagrindinės priemonės rūšis	Įrašoma informacija apie tokių rūšių sandorius, kurie nėra apsikeitimo sandoriai, pasirinkimo sandoriai dėl apsikeitimo sandorių, ateities sandoriai dėl apsikeitimo sandorių ir išankstiniai sandoriai dėl apsikeitimo sandorių, taikant vieną iš toliau nurodytų alternatyvų. Įrašoma informacija apie apsikeitimo sandorius, pasirinkimo sandorius dėl apsikeitimo sandorių, ateities sandorius dėl apsikeitimo sandorių ir išankstinius sandorius dėl apsikeitimo sandorių pagrindinio apsikeitimo sandorio atžvilgiu, taikant vieną iš toliau nurodytų alternatyvų.	BOND – obligacija BNDF – obligacijų ateities sandoriai INTR – palūkanų norma IFUT – palūkanų normų ateities sandoriai (FRA) FFMC – APSIKEITIMO KELIOMIS VALIUTOMIS KINTAMOMIS PALŪKANOMIS SANDORIAI XFMC – APSIKEITIMO KELIOMIS VALIUTOMIS FIKSUOTOMIS/KINTAMOMIS PALŪKANOMIS SANDORIAI XXMC – APSIKEITIMO KELIOMIS VALIUTOMIS FIKSUOTOMIS PALŪKANOMIS SANDORIAI OSMC – APSIKEITIMO PALŪKANŲ NORMOMIS PAGAL VIENOS NAKTIES INDEKSŲ APSIKEITIMO SANDORIUS KELIOMIS VALIUTOMIS SANDORIAI IFMC – APSIKEITIMO INFLIACIJOS RIZIKA KELIOMIS VALIUTOMIS SANDORIAI FFSC – APSIKEITIMO VIENA VALIUTA KINTAMOMIS PALŪKANOMIS SANDORIAI XFSC– APSIKEITIMO VIETA VALIUTA SANDORIAI, KAI VIENAI ŠALIAI NUSTATOMOS FIKSUOTOS, O KITAI – KINTAMOS PALŪKANOS XXSC – APSIKEITIMO VIENA VALIUTA FIKSUOTOMIS PALŪKANOMIS SANDORIAI OSSC – APSIKEITIMO PALŪKANŲ NORMOMIS PAGAL VIENOS NAKTIES INDEKSŲ APSIKEITIMO SANDORIUS VIENA VALIUTA SANDORIAI IFSC – APSIKEITIMO INFLIACIJOS RIZIKA VIENA VALIUTA SANDORIAI
17	Pagrindinės obligacijos emitentas	Pildytina, kai pagrindinė priemonė yra obligacija arba obligacijų ateities sandoris, nurodant tiesioginės ar galutinės pagrindinės obligacijos emitento juridinio asmens identifikatorių (LEI).	{LEI}

#	LAUKELIS	IŠSAMI INFORMACIJA, KURIĄ REIKIA PATEIKTI	ATASKAITŲ TEIKIMO FORMA
18	Pagrindinės obligacijos termino data	Pildytina nurodant pagrindinės obligacijos termino datą. Laukelis skirtas skolos priemonėms su nustatyta išpirkimo data.	{DATEFORMAT}
19	Pagrindinės obligacijos emisijos data	Pildytina nurodant pagrindinės obligacijos emisijos datą	{DATEFORMAT}
20	Pasirinkimo sandorio dėl apsikeitimo sandorio tariamoji valiuta	Pildytina pasirinkimo sandorių dėl apsikeitimo sandorių atveju.	{CURRENCYCODE_3}
21	Pagrindinio apsikeitimo sandorio galiojimo terminas	Pildytinas tik pasirinkimo sandorių dėl apsikeitimo sandorių, ateities sandorių dėl apsikeitimo sandorių ir išankstinių sandorių dėl apsikeitimo sandorių atvejais.	{DATEFORMAT}
22	Infliacijos indekso ISIN kodas	Pasirinkimo sandorių dėl apsikeitimo sandorių atveju, kai pagrindinis apsikeitimo sandoris yra apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandoris, ateities/išankstinis sandoris dėl apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandorių, apsikeitimo infliacijos rizika keliomis valiutomis sandoris arba ateities/išankstinis sandoris dėl apsikeitimo infliacijos rizika keliomis valiutomis sandorių, laukelyje nurodomas infliacijos indekso ISIN kodas, jei yra.	{ISIN}
23	Infliacijos indekso pavadinimas	Pildytina nurodant standartizuotą indekso pavadinimą, kai apsikeitimo sandorių pagrindinis apsikeitimo sandoris yra apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandoris, ateities/išankstinis sandoris dėl apsikeitimo infliacijos rizika viena valiuta sandorių, apsikeitimo infliacijos rizika keliomis valiutomis sandoris arba ateities/išankstinis sandoris dėl apsikeitimo infliacijos rizika keliomis valiutomis sandorių.	{ALPHANUM-25}
24	Orientacinė palūkanų norma	Orientacinės palūkanų normos pavadinimas.	{INDEX} arba {ALPHANUM-25} – jeigu orientacinė norma neįtraukta į {INDEX} sąrašą.
25	Palūkanų normų sandorio terminas	Šiame laukelyje nurodomas sutarties galiojimo terminas. Terminas nurodomas dienomis, savaitėmis, mėnesiais ar metais.	{INTEGER-3}+DAYS – dienos {INTEGER-3}+WEEK – savaitės {INTEGER-3}+MNTH – mėnesiai {INTEGER-3}+YEAR – metai

Užsienio valiutos išvestinės finansinės priemonės

Šio skirsnio laukeliai pildomi tik užsienio valiutos išvestinių finansinių priemonių, kaip apibrėžta III priedo 8 skirsnio 8.1 lentelėje, atveju.

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

#	LAUKELIS	IŠSAMI INFORMACIJA, KURIĄ REIKIA PATEIKTI	ATASKAITŲ TEIKIMO FORMA
Su nuosavybės vertybiniais popieriais susietos išvestinės finansinės priemonės			
Laukeliai pildomi tik su nuosavybės vertybiniais popieriais susietų išvestinių finansinių priemonių, kaip apibrėžta III priedo 6 skirsnio 6.1 lentelėje, atveju.			
27	Pagrindinės priemonės rūšis	Pildytina, kai FPRR identifikavimo kodas – išvestinė finansinė priemonė, pagrindinės priemonės turto klasė –nuosavas kapitalas, o turto poklasis nėra nei apsikeitimo sandoris, nei portfelio apsikeitimo sandoris.	STIX – akcijų indeksas SHRS – akcija DIVI – dividendų indeksas DVSE – akcijų dividendai BSKT – emitento įvykių nulemtas akcijų krepšelis ETFS – biržiniai fondai VOLI – kintamumo indeksas OTHR – kita (įskaitant depozitoriumo pakvitavimus, sertifikatus ir kitas į nuosavybės finansines priemones panašias priemones)
		Pildytina, kai FPRR identifikavimo kodas – išvestinė finansinė priemonė, pagrindinės priemonės turto klasė –nuosavas kapitalas, turto poklasis – apsikeitimo sandoriai arba portfelio apsikeitimo sandoriai, o III priedo 6 skirsnio 6.1 lentelėje apibrėžtas 2 segmentavimo kriterijus yra vienas pavadinimas.	SHRS – akcija DVSE – akcijų dividendai ETFS – biržiniai fondai OTHR – kita (įskaitant depozitoriumo pakvitavimus, sertifikatus ir kitas į nuosavybės finansines priemones panašias priemones)
		Pildytina, kai FPRR identifikavimo kodas – išvestinė finansinė priemonė, pagrindinės priemonės turto klasė –nuosavas kapitalas, turto poklasis – apsikeitimo sandoriai arba portfelio apsikeitimo sandoriai, o III priedo 6 skirsnio 6.1 lentelėje apibrėžtas 2 segmentavimo kriterijus yra indeksas.	STIX – akcijų indeksas DIVI – dividendų indeksas VOLI – kintamumo indeksas OTHR – kita
		Pildytina, kai FPRR identifikavimo kodas – išvestinė finansinė priemonė, pagrindinės priemonės turto klasė –nuosavas kapitalas, turto poklasis – apsikeitimo sandoriai arba portfelio apsikeitimo sandoriai, o III priedo 6 skirsnio 6.1 lentelėje apibrėžtas 2 segmentavimo kriterijus yra krepšelis.	BSKT – krepšelis
28	Parametras	Pildytina, kai FPRR identifikavimo kodu žymima išvestinė finansinė priemonė, pagrindinės priemonės turto klasė yra nuosavybė, o turto poklasis yra arba apsikeitimo sandoris, arba portfelio apsikeitimo sandoris.	PRBP – kainos grąžos pagrindinis rezultatų parametras PRDV – grąžos dividendų parametras PRVA – grąžos dispersijos parametras PRVO – grąžos kintamumo parametras
Sandoriai dėl kainų skirtumo			
Laukeliai turi būti pildomi tik atveju, jei sandorio tipas yra sandoris dėl skirtumų ar kainų skirtumų lažybos.			
29	Pagrindinės priemonės rūšis	Pildytina, jei FPRR identifikavimo kodu žymima išvestinė finansinė priemonė, o susitarimo tipas yra susitarimas dėl skirtumų ar kainų skirtumų lažybos.	CURR – valiuta EQUI – nuosavybės vertybinis popierius

#	LAUKELIS	IŠSAMI INFORMACIJA, KURIĄ REIKIA PATEIKTI	ATASKAITŲ TEIKIMO FORMA
			BOND – obligacijos FTEQ – ateities sandoriai dėl nuosavybės vertybinių popierių OPEQ – pasirinkimo sandoriai dėl nuosavybės vertybinių popierių COMM – biržos prekės EMAL – apyvartiniai taršos leidimai OTHR – kita
30	1 tariamosios sumos valiuta	Pagrindinės valiutų poros 1-oji valiuta. Laukelis taikytinas, kai pagrindinės priemonės rūšis yra valiuta.	{CURRENCYCODE_3}
31	2 tariamosios sumos valiuta.	Pagrindinės valiutų poros 2-oji valiuta. Laukelis taikytinas, kai pagrindinės priemonės rūšis yra valiuta.	{CURRENCYCODE_3}
Kredito išvestinės finansinės priemonės			
32	Pagrindinio kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorio ISIN kodas	Pildytina kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių išvestinių finansinių priemonių atveju, nurodant pagrindinio apsikeitimo sandorio ISIN kodą.	{ISIN}
33	Pagrindinio indekso kodas	Pildytina išvestinių finansinių priemonių, susijusių su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, atveju, nurodant indekso ISIN kodą.	{ISIN}
34	Pagrindinio indekso pavadinimas	Pildytina išvestinių finansinių priemonių, susijusių su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, atveju, nurodant standartizuotą indekso pavadinimą.	{ALPHANUM-25}
35	Serija	Indekso sudėties serijos numeris, jei yra. Pildytina kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indekso arba išvestinių finansinių priemonių, susijusių su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, atveju, nurodant to indekso seriją.	{DECIMAL-18/17}
36	Versija	Nauja serijos versija išleidžiama, jei viena iš sudedamųjų dalių neatitinka reikalavimų ir indeksą reikia iš naujo įvertinti, kad būtų atsižvelgta į naują bendrą sudedamųjų indekso dalių skaičių. Pildytina kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indekso arba išvestinių finansinių priemonių, susijusių su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, atveju nurodant to indekso versiją.	{DECIMAL-18/17}
37	Atnaujinimo mėnesiai	Visi mėnesiai, kuriais numatomas atnaujinimas, kaip nustatyta indekso sudarytojo konkretiems metams. Laukelis kartojamas kiekvienam atnaujinimo mėnesiui. Pildytina kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indekso arba išvestinių finansinių priemonių, susijusių su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, atveju.	01, 02, 03, 04, 05, 06, 07, 08, 09, 10, 11, 12
38	Kito atnaujinimo data	Pildytina kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indekso arba išvestinių finansinių priemonių, susijusių su kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių indeksu, atveju, nurodant kitą indekso atnaujinimo datą, kurią nustato indekso sudarytojas.	{DATEFORMAT}

#	LAUKELIS	IŠSAMI INFORMACIJA, KURIĄ REIKIA PATEIKTI	ATASKAITŲ TEIKIMO FORMA
39	Valstybinio ir viešojo tipo emitentas	Pildytina, jei vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorio arba išvestinės finansinės priemonės, susijusios su vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriu, referencinis subjektas yra valstybės skolos vertybinių popierių emitentas, kaip apibrėžta III priedo 9 skirsnio 9.1 lentelėje.	„TRUE“ – referencinis subjektas yra valstybinio ir viešojo tipo emitentas „FALSE“ – referencinis subjektas nėra valstybinio ir viešojo tipo emitentas
40	Pagrindinė pozicija	Pildytina vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorių išvestinių finansinių priemonių atveju, nurodant pagrindinės pozicijos ISIN kodą.	{ISIN}
41	Referencinis subjektas	Pildytina įrašant vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandorio arba išvestinės finansinės priemonės, susijusios su vieno pavadinimo kredito įsipareigojimų neįvykdymo apsikeitimo sandoriu, referencinį subjektą.	{COUNTRYCODE_2} arba ISO 3166–2 – dviraidis valstybės kodas, po jo – brūkšnelis „-“ ir ne daugiau nei 3 raidinių skaitinių simbolių smulkesnių valstybės vienetų kodas arba {LEI}
42	Tariamosios sumos valiuta	Valiuta, kuria denominuota tariamoji suma	{CURRENCYCODE_3}
Apyvartinių taršos leidimų išvestinės finansinės priemonės Šio skirsnio laukeliai pildomi tik apyvartinių taršos leidimų, kaip apibrėžta III priedo 13 skirsnio 13.1 lentelėje, atveju.			
43	Apyvartinių taršos leidimų išvestinių finansinių priemonių porūšis	Pildytina, kai kintamasis #3 „FPRR identifikavimo kodas“ yra DERV (išvestinės finansinės priemonės), o kintamasis #4 „pagrindinės priemonės turto klasė“ yra EMAL (apyvartiniai taršos leidimai).	CERE – CER ERUE – ERU EUAE – EUA EUAA – EUAA OTHR – kita