

KOMISIJAS DELEĢĒTĀ REGULA (ES) 2017/583**(2016. gada 14. jūlijs),**

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

(Dokuments attiecas uz EEZ)

EIROPAS KOMISIJA,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Parlamenta un Padomes 2014. gada 15. maija Regulu (ES) Nr. 600/2014 par finanšu instrumentu tirgiem, ar kuru groza Regulu (EK) Nr. 648/2012 ⁽¹⁾, un jo īpaši tās 1. panta 8. punktu, 9. panta 5. punktu, 11. panta 4. punktu, 21. panta 5. punktu un 22. panta 4. punktu,

tā kā:

- (1) Ir nepieciešama augsta pārredzamības pakāpe, lai nodrošinātu, ka ieguldītāji ir pienācīgi informēti par patieso līmeni attiecībā uz faktiskajiem un potenciāliem darījumiem ar obligācijām, strukturētā finansējuma produktiem, emisijas kvotām un atvasinātajiem instrumentiem, neatkarīgi no tā, vai minētie darījumi tiek veikti regulētos tirgos, daudzpusējās tirdzniecības sistēmās (DTS), organizētās tirdzniecības sistēmās, sistemātiskajos internalizētajos vai ārpus minētajām sistēmām. Šai augstajai pārredzamības pakāpei būtu arī jāizveido vienlīdzīgi konkurences apstākļi starp tirdzniecības vietām, lai likviditātes sadrumstalotība nemazina cenu atklāšanas procesu attiecībā uz konkrētiem finanšu instrumentiem, un ieguldītāji nenonāk neizdevīgā situācijā.
- (2) Tajā pašā laikā ir svarīgi atzīt, ka var būt apstākļi, kuros būtu jānodrošina atbrīvojumi no pirmstirdzniecības pārredzamības vai pēctirdzniecības pārredzamības pienākumu atlikšana, lai novērstu likviditātes pasliktināšanos, ko var izraisīt negribētas sekas pienākumam atklāt informāciju par darījumiem un tādējādi darīt zināmus atklātībai riska faktorus. Tādēļ ir lietderīgi konkretizēt precīzus apstākļus, kādos var piešķirt atbrīvojumus no pirmstirdzniecības pārredzamības un pēctirdzniecības pārredzamības atlikšanu.
- (3) Šīs regulas noteikumi ir cieši saistīti, jo tajos ir precizētas pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības pārredzamības prasības, kas attiecas uz tirdzniecību ar instrumentiem, kas nav kapitāla vērtspapīru finanšu instrumenti. Lai nodrošinātu saskaņotību starp šiem noteikumiem, kuriem būtu jāstājas spēkā vienlaikus, un sekmētu vispusīgu priekšstatu ieinteresētajām personām un it īpaši tām, uz kurām šie pienākumi attiecas, ir nepieciešams šos regulatīvos tehniskos standartus iekļaut vienā regulā.
- (4) Ja kompetentās iestādes piešķir atbrīvojumus attiecībā uz pirmstirdzniecības pārredzamības prasībām vai pilnvaro pēctirdzniecības pārredzamības pienākumu atlikšanu, tām būtu jānodrošina vienlīdzīga un nediskriminējoša attieksme pret visiem regulētajiem tirgiem, daudzpusējām tirdzniecības sistēmām, organizētajām tirdzniecības sistēmām un ieguldījumu brokeru sabiedrībām, kas veic tirdzniecību ārpus tirdzniecības vietām.
- (5) Ir lietderīgi sniegt paskaidrojumu par konkrētu skaitu tehnisku terminu. Minētās tehniskās definīcijas ir nepieciešamas, lai nodrošinātu šajā regulā ietverto noteikumu vienādu piemērošanu Savienībā un līdz ar to veicinātu vienota noteikumu kopuma izveidi Savienības finanšu tirgiem. Minētās definīcijas ir nepieciešamas tikai nolūkā izklāstīt pārredzamības pienākumus attiecībā uz instrumentiem, kas nav kapitāla vērtspapīru instrumenti, un tām būtu stingri jāattiecas tikai uz šīs regulas izpratni.
- (6) Biržā tirgotas preces (ETC) un biržā tirgotas parādzīmes (ETN), kurām piemēro šo regulu, būtu jāuzskata par parāda instrumentiem to juridiskās struktūras dēļ. Tomēr tā kā to tirdzniecība ir līdzīga biržā tirgotu fondu tirdzniecībai, būtu jāpiemēro līdzīgs pārredzamības režīms, ko piemēro biržā tirgotiem fondiem.

⁽¹⁾ (OV L 173, 12.6.2014., 84. lpp.).

- (7) Saskaņā ar Regulu (ES) Nr. 600/2014 vairāki instrumenti būtu jāuzskata par atbilstīgiem pirmstirdzniecības pārredzamības atbrīvojumam, ko piemēro instrumentiem, kuriem nav likvīda tirgus. Šī prasība arī būtu jāattiecinā uz atvasinātajiem instrumentiem, kuriem piemēro tūrvērtes pienākumu, bet kuriem nepiemēro pienākumu veikt tirdzniecību, kā arī obligācijām, atvasinātajiem instrumentiem, strukturētā finansējuma produktiem un emisijas kvotām, kas nav likvīdas.
- (8) Tirdzniecības vietai, kura uztur cenu piedāvājumu pieprasīšanas sistēmu, būtu jāpublicē stabilas pirkšanas un pārdošanas piedāvājumu cenas vai izmantojamas norādes par interesi un ar minētajām cenām saistīto tirdzniecības sesijas "dziļumu", vēlākais, tajā brīdī, kad pieprasītājs spēj veikt darījumu, ievērojot minētās sistēmas noteikumus. Tas ir nepieciešams, lai nodrošinātu, ka locekļi vai dalībnieki, kuri pirmie sniedz savus cenu piedāvājumus pieprasītājam, nenonāktu neizdevīgā situācijā.
- (9) Lielākā daļa likvīdu segto obligāciju ir hipotēkas obligācijas, kas izsniegtas, lai piešķirtu aizdevumus privātpersonu mājokļa iegādes finansēšanai, un to vidējā vērtība ir tieši saistīta ar aizdevuma vērtību. Segto obligāciju tirgū likviditātes nodrošinātāji nodrošina, ka profesionālie ieguldītāji, kas slēdz liela apjoma darījumus, tiek savietoti ar mājokļu īpašniekiem, kas slēdz neliela apjoma darījumus. Lai novērstu šīs funkcijas traucējumus un no tiem izrietošās nelabvēlīgās sekas mājokļu īpašniekiem, apmērs, kas raksturīgs iepriekš minētajam instrumentam, kuru pārsniedzot, likviditātes nodrošinātāji var iegūt atbrīvojumu no pirmstirdzniecības pārredzamības, būtu jānosaka tirdzniecības apjomā, kas pārsniedz 40 % darījumu, jo uzskata, ka šāds tirdzniecības apjoms atspoguļo mājokļa vidējo cenu.
- (10) Informācija, kas ir jādara pieejama iespējami tuvāk reāllaikam, būtu jādara pieejama nekavējoties, cik vien tehniski iespējams, pieņemot, ka attiecīgais tirgus uzturētājs, apstiprināta publicēšanas struktūra (APS) vai ieguldījumu brokeru sabiedrība attiecībā uz sistēmām ir nodrošinājusi saprātīgu izmaksu līmeni un efektivitāti. Informāciju var publicēt tuvu iepriekš noteiktam maksimālajam termiņam tikai ārkārtējos gadījumos, ja pieejamās sistēmas nepieļauj informācijas publicēšanu īsākā laikā.
- (11) Ieguldījumu brokeru sabiedrībām būtu jāpublicē informācija par darījumiem, kas izpildīti ārpus tirdzniecības vietas, izmantojot APS. Šajā regulā būtu jānosaka veids, kādā ieguldījumu brokeru sabiedrības ziņo par saviem darījumiem APS, un tā būtu jāpiemēro saistībā ar Komisijas Deleģēto regulu (ES) 2017/571 ⁽¹⁾.
- (12) Regulā (ES) Nr. 600/2014 ir noteikta iespēja precizēt, kā tiek īstenots pienākums veikt pirmstirdzniecības informācijas atklāšanu par darījumiem, kas noslēgti starp divām ieguldījumu brokeru sabiedrībām, tostarp sistemātiskajiem internalizētājiem, ar obligācijām, strukturētā finansējuma produktiem, emisijas kvotām un atvasinātajiem instrumentiem, kurus nosaka faktori, kas nav pašreizējā tirgus vērtība, piemēram, finanšu instrumentu kā nodrošinājuma pārvešana. Šādi darījumi neveicina cenu atklāšanas procesu vai rada risku, radot neskaidrības ieguldītājiem, vai kavē labāko izpildi, tādēļ šajā regulā ir precizēti darījumi, kurus nosaka faktori, kas nav pašreizējā tirgus vērtība, kuri nebūtu jāpublicē.
- (13) Ieguldījumu brokeru sabiedrības savā vārdā vai klientu vārdā bieži veic darījumus ar atvasinātajiem instrumentiem un citiem finanšu instrumentiem vai aktīviem, ko veido vairāki savstarpēji saistīti nosacīti darījumi. Šādi paketes darījumi sniedz iespēju ieguldījumu brokeru sabiedrībām un to klientiem labāk pārvaldīt savus riskus attiecībā uz paketes darījuma katras komponentes cenu, kas atspoguļo paketes vispārējo riska profilu, nevis katras komponentes dominējošo tirgus cenu. Paketes darījumi var izpausties dažādos veidos, piemēram, kā apmaiņa ar fiziskiem līdzekļiem, tirdzniecības vietās īstenotas tirdzniecības stratēģijas vai nestandartizēti paketes darījumi, un ir svarīgi šīs īpatnības ņemt vērā, pielāgojot piemērojamo pārredzamības režīmu. Tādēļ ir lietderīgi šīs regulas nolūkos precizēt nosacījumus, lai paketes darījumiem piemērotu pēctirdzniecības pārredzamības atlikšanu. Šādi pasākumi nebūtu jādara pieejami darījumiem, ar ko ierobežo finanšu instrumentu risku un kuri ir noslēgti, veicot parastu uzņēmējdarbību.
- (14) Apmaiņa ar fiziskiem līdzekļiem ir finanšu tirgu būtiska daļa, ļaujot tirgus dalībniekiem organizēt un izpildīt darījumus ar biržā tirgotiem atvasinātajiem instrumentiem, kuri ir tieši saistīti ar konkrētu darījumu pamatā esošajā fiziskajā tirgū. Tos plaši izmanto, un tie ietver vairākus dalībniekus, piemēram, lauksaimniekus, izgata-votājus, ražotājus un preču apstrādātājus. Parasti apmaiņa ar fiziskiem līdzekļiem notiek tad, ja fiziskā aktīva

⁽¹⁾ Komisijas 2016. gada 2. jūnija Deleģētā regula (ES) 2017/571, ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 2014/65/ES papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par atļauju izsniegšanu, organizatoriskām prasībām un darījumu publicēšanu attiecībā uz datu ziņošanas pakalpojumu sniedzējiem (skatīt šā *Oficiālā Vēstneša* 126. lappusi).

pārdevējs mēģina slēgt savu attiecīgo riska ierobežošanas pozīciju atvasināto instrumentu līgumā ar fiziskā aktīva pircēju, kas arī tur attiecīgo riska ierobežošanas pozīciju tajā pašā atvasināto instrumentu līgumā. Līdz ar to viņi sekmē vairs nevajadzīgu ierobežošanas pozīciju efektīvu noslēgšanu.

- (15) Attiecībā uz darījumiem, kas izpildīti, neievērojot tirdzniecības vietas noteikumus, ir svarīgi precizēt, kurai ieguldījumu brokeru sabiedrībai ir jāpublicē darījums gadījumos, kad abas darījuma puses ir ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas veic uzņēmējdarbību Savienībā, lai nodrošinātu, ka darījumu publicēšana nenotiek divkārti. Tādēļ atbildība par darījuma publicēšanu vienmēr būtu jāuzņemas ieguldījumu brokeru sabiedrībai, kas veic pārdošanu, izņemot, ja viena no pusēm ir sistēmiskais internalizētājs un ja tā ir ieguldījumu brokeru sabiedrība, kas veic iegādi.
- (16) Ja tikai viena no darījuma pusēm ir sistēmiskais internalizētājs darījumā ar konkrētu finanšu instrumentu un ir arī ieguldījumu brokeru sabiedrība, kas veic attiecīgā instrumenta iegādi, tai būtu jāuzņemas atbildība par šāda darījuma publicēšanu, jo tās klienti sagaidītu šādu rīcību un tā ir labākā situācijā, lai aizpildītu paredzēto lauku, norādot savu sistēmiskā internalizētāja statusu. Lai nodrošinātu, ka darījums tiek publicēts tikai vienreiz, sistēmiskajam internalizētājam būtu jāpaziņo otrai pusei, ka tas publicē attiecīgo darījumu.
- (17) Ir svarīgi uzturēt pašreizējos standartus tādu darījumu publicēšanai, kas veikti kā kompensējoši darījumi, lai novērstu to, ka viens darījums tiek publicēts kā vairāki darījumi, un lai nodrošinātu juridisko noteiktību par to, kura ieguldījumu brokeru sabiedrība ir atbildīga par darījuma publicēšanu. Tādēļ divi sapāroti darījumi, kas iegrāmatoti par to pašu cenu vienam un tam pašam darījuma partnerim vienlaikus, būtu jāpublicē kā viens darījums.
- (18) Ar Regulu (ES) Nr. 600/2014 kompetentajām iestādēm ļauj pieprasīt, lai tiktu publicēti papildu dati, kad tiek publicēta informācija par atlikšanu, vai ļaut piešķirt atlikšanu uz ilgāku laika posmu. Lai veicinātu šo noteikumu vienādu piemērošanu visā Savienībā, ir jāparedz nosacījumi un kritēriji, saskaņā ar kuriem kompetentās iestādes var piešķirt papildu atlikšanu.
- (19) Tirdzniecība ar daudziem instrumentiem, kas nav kapitāla vērtspapīru finanšu instrumenti, jo īpaši ar atvasinātajiem instrumentiem, ir epizodiska, mainīga un pakļauta tirdzniecības modeļu regulārām izmaiņām. Nebūtu piemēroti piešķirt pastāvīgu statusu finanšu instrumentiem, kuriem nav likvīda tirgus, un nemainīgi noteikt dažādas robežvērtības nolūkā kalibrēt pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības pārredzamības pienākumus, nenodrošinot iespēju pielāgot likviditātes statusu un robežvērtības saistībā ar tirdzniecības modeļu pārmaiņām. Tādēļ ir piemēroti paredzēt metodi un parametrus, kuri ir nepieciešami, lai veiktu likviditātes novērtējumu un robežvērtību aprēķināšanu pirmstirdzniecības pārredzamības atbrīvojumu un pēctirdzniecības pārredzamības atlikšanu regulārai piemērošanai.
- (20) Lai nodrošinātu pirmstirdzniecības pārredzamības un pēctirdzniecības atlikšanas konsekventu piemērošanu, ir nepieciešams izstrādāt vienādus noteikumus attiecībā uz to datu saturu un biežumu, ko kompetentās iestādes var pieprasīt no tirdzniecības vietām, APS un konsolidētu datu lentes nodrošinātājiem (KDLN) pārredzamības nolūkos. Ir arī nepieciešams precizēt metodi attiecīgo robežvērtību aprēķināšanai un izstrādāt vienādus noteikumus attiecībā uz informācijas publicēšanu visā Savienībā. Konkrētā metode un dati, kas nepieciešami, lai veiktu aprēķinus ar mērķi precizēt pārredzamības režīmu, kas piemērojams instrumentiem, kas nav kapitāla vērtspapīru finanšu instrumenti, būtu jāpiemēro saistībā ar Komisijas Deleģēto regulu (ES) 2017/577⁽¹⁾, kurā izklāstīti kopējie elementi attiecībā uz tādu datu saturu un biežumu, kas jāpieprasa no tirdzniecības vietām, apstiprinātām publicēšanas struktūrām un konsolidētu datu lentes nodrošinātājiem pārredzamības un citu aprēķinu nolūkos kopumā.
- (21) Attiecībā uz obligācijām, kas nav biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes, darījumus, kas ir zemāki par EUR 100 000, būtu jāizslēdz no pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības pārredzamības robežvērtību aprēķiniem, jo tos uzskata par privāto ieguldījumu darījumiem. Minētajiem privāto ieguldījumu darījumiem visos gadījumos būtu jāgūst labums no jaunā pārredzamības režīma, un visas robežvērtības, uz kā pamata tiek piešķirts atbrīvojums vai pārredzamības atlikšana, būtu jānosaka virs minētā līmeņa.
- (22) Regulā (ES) Nr. 600/2014 noteiktā atbrīvojuma no pārredzamības pienākumiem mērķis ir nodrošināt, ka Eurosistēmas veikto operāciju efektivitāti, veicot galvenos uzdevumus, kā izklāstīts Eiropas Centrālo banku

⁽¹⁾ Komisijas 2016. gada 13. jūnija Deleģētā regula (ES) 2017/577, ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 600/2014 par finanšu instrumentu tirgiem papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par apjoma ierobežošanas mehānismu un informācijas sniegšanu pārredzamības un citu aprēķinu nolūkā (skatīt šā Oficiālā Vēstneša 174. lappusi).

sistēmas un Eiropas Centrālās bankas Statūtos, kas pievienoti Līgumam par Eiropas Savienību ("Statūti"), un saskaņā ar līdzvērtīgām valsts tiesību normām Eiropas Centrālo banku sistēmas (ECBS) locekļiem dalībvalstīs, kuru valūta nav euro, kuras paļaujas uz savlaicīgiem un konfidencialiem darījumiem, neapdraud informācijas atklāšana par šādiem darījumiem. Ir svarīgi, lai centrālās bankas spētu kontrolēt, vai, kad un kā informācija par to darbībām tiek atklāta, lai maksimāli palielinātu plānoto ietekmi un ierobežotu jebkādu neplānotu ietekmi uz tirgu. Tādēļ ECBS locekļiem un to attiecīgajiem darījumu partneriem būtu jānodrošina juridiskā noteiktība attiecībā uz darbības jomu, kurā piemēro atbrīvojumu no pārredzamības prasībām.

- (23) Viens no galvenajiem ECBS pienākumiem saskaņā ar Līgumu un statūtiem un saskaņā ar valsts tiesību normām ECBS dalībniekiem dalībvalstīs, kuru valūta nav euro, ir ārvalstu valūtas politikas darbība, kas ietver ārvalstu valūtu rezervju turēšanu un pārvaldību, lai nodrošinātu, ka vajadzības gadījumā ir pieejams pietiekams daudzums likvidu resursu tās ārvalstu valūtas politikas darbībām. Piemērojot pārredzamības prasības ārējo rezervju pārvaldības darbībām, var rasties neparedzēti signāli tirgum, kas varētu traucēt Eurosistēmas ārvalstu valūtas politiku un ECSB locekļu ārvalstu valūtas politiku dalībvalstīs, kuru valūta nav euro. Līdzīgi apsvērumi arī var attiekties uz ārējo rezervju pārvaldības darbībām, īstenojot monetāro un finanšu stabilitātes politiku katrā atsevišķā gadījumā.
- (24) Atbrīvojums no pārredzamības pienākumiem attiecībā uz darījumiem, kuros darījumu partneris ir ECBS loceklis, nebūtu jāpiemēro attiecībā uz darījumiem, kurus noslēdzis jebkurš ECBS dalībnieks, veicot savas investīciju operācijas. Tam būtu jāietver operācijas, kas veiktas administratīvos nolūkos vai ECBS locekļa darbiniekam, tostarp darījumi, kurus veicis pensiju shēmas pārvaldnieks saskaņā ar statūtu 24. pantu.
- (25) Pārredzamības pienākumu pagaidu apturēšana būtu jāpiemēro tikai ārkārtējās situācijās, kas norāda uz būtisku likviditātes samazināšanos finanšu instrumentu klasē, pamatojoties uz objektīviem un izmērāmiem faktoriem. Ir nepieciešams nošķirt klases, par kurām sākotnēji ir noteikts, ka tām ir likvids tirgus vai tā nav, jo, visticamāk, ka turpmāks būtisks samazinājums relatīvā izteiksmē ātrāk notiks tajā klasē, kas jau noteikta kā nelikvida. Līdz ar to pārredzamības prasību apturēšana attiecībā uz instrumentiem, par kuriem ir noteikts, ka tiem nav likvida tirgus, būtu jāpiemēro tikai tad, ja ir samazinājusies augstāka relatīvā robežvērtība.
- (26) Ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 izveidotais pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības pārredzamības režīms būtu atbilstīgi jāpielāgo tirgum un jāpiemēro vienādi visā Savienībā. Līdz ar to ir svarīgi noteikt nepieciešamos veicamos aprēķinus, tostarp aprēķināšanas laikposmus un metodes. Tādēļ, lai novērstu tirgus traucējumu sekas, šajā regulā noteiktajiem aprēķināšanas laikposmiem būtu jānodrošina, ka attiecīgās režīma robežvērtības tiek atjauninātas pienācīgos intervālos, lai atspoguļotu tirgus apstākļus. Ir arī lietderīgi nodrošināt, ka aprēķinu rezultāti tiek publicēti centralizēti, lai tos darītu pieejamus visiem finanšu tirgus dalībniekiem un kompetentajām iestādēm Savienībā vienuviet un lietotājam parocīgā veidā. Tādēļ kompetentajām iestādēm būtu jāpaziņo EVTI par savu aprēķinu rezultātiem un EVTI būtu jāpublicē minētie aprēķini savā tīmekļa vietnē.
- (27) Lai nodrošinātu jauno pārredzamības prasību raitu īstenošanu, ir lietderīgi pakāpeniski ieviest pārredzamības noteikumus. Likviditātes robežvērtība "vidējais dienas darījumu skaits", kas izmantots, lai noteiktu obligācijas, kurām ir likvids tirgus, būtu jāpielāgo pakāpeniski.
- (28) Līdz 30. jūlijam gadā pēc Regulas (ES) Nr. 600/2014 piemērošanas dienas EVTI katru gadu būtu Komisijai jāiesniedz novērtējums par likviditātes robežvērtību, kas nosaka pirmstirdzniecības pārredzamības pienākumus saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 8. un 9. pantu un, attiecīgā gadījumā, jāiesniedz pārskatīts regulatīvais tehniskais standarts, lai pielāgotu likviditātes robežu.
- (29) Tāpat tirdzniecības procentiles, ko izmanto, lai noteiktu konkrētam instrumentam raksturīgu apjomu, ar ko ļauj piešķirt atbrīvojumu no pirmstirdzniecības pārredzamības pienākumiem attiecībā uz instrumentiem, kas nav kapitāla vērtspapīru finanšu instrumenti, būtu jāpielāgo pakāpeniski.
- (30) Šajā nolūkā EVTI katru gadu būtu Komisijai jāiesniedz novērtējums par atbrīvojuma robežvērtībām un, attiecīgā gadījumā, jāiesniedz pārskatīts regulatīvais standarts, lai pielāgotu atbrīvojuma robežvērtības, kuras piemēro instrumentiem, kas nav kapitāla vērtspapīru finanšu instrumenti.

- (31) Pārredzamības aprēķinu nolūkā ir nepieciešami atsaucē dati, lai noteiktu aktīvu apakšklasi, pie kuras pieder katrs finanšu instruments. Līdz ar to ir nepieciešams tirdzniecības vietām pieprasīt, lai papildus datiem, kurus pieprasa ar Komisijas Deleģēto regulu (ES) 2017/585 ⁽¹⁾, tās nodrošinātu atsaucē datus.
- (32) Nosakot finanšu instrumentus, kam nav likvīda tirgus attiecībā uz ārvalstu valūtas atvasinātajiem instrumentiem, bija nepieciešams veikt kvalitatīvu novērtējumu, jo nebija datu visaptverošai kvantitatīvai analīzei par visu tirgu. Tā rezultātā līdz brīdim, kad kļuvis pieejami labākas kvalitātes dati, būtu jāuzskata, ka ārvalstu valūtas atvasinātajiem instrumentiem nav likvīda tirgus šīs regulas nolūkos.
- (33) Lai sāktu efektīvi piemērot jaunus pārredzamības noteikumus, tirgus dalībniekiem būtu jānodrošina dati tādu finanšu instrumentu aprēķināšanai un publicēšanai, kuriem nav likvīda tirgus, un rīkojumiem, kuri ir lieli pēc apjoma vai pārsniedz konkrētam instrumentam raksturīgo apjomu, pietiekami savlaicīgi pirms Regulas (ES) Nr. 600/2014 piemērošanas dienas.
- (34) Konsekvences labad un lai nodrošinātu finanšu tirgu netraucētu darbību, ir nepieciešams noteikt, ka šo regulu un Regulā (ES) Nr. 600/2014 paredzētos noteikumus piemēro no tās pašas dienas. Tomēr, lai nodrošinātu, ka jaunais pārredzamības režīms var efektīvi darboties, konkrēti šīs regulas noteikumi būtu jāpiemēro no regulas spēkā stāšanās dienas.
- (35) Šī regula balstās uz regulatīvo tehnisko standartu projektu, ko EVTI iesniegusi Komisijai.
- (36) EVTI ir veikusi atklātu sabiedrisko apspriešanu par regulatīvo tehnisko standartu projektu, kas ir šīs regulas pamatā, izvērtējusi iespējamās saistītās izmaksas un ieguvumus un lūgusi ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 1095/2010 37. pantu izveidotās Vērtspapīru un tirgu nozares ieinteresēto personu grupas atzinumu ⁽²⁾,

IR PIENĒMUSI ŠO REGULU.

I NODAĻA

DEFINĪCIJAS

1. pants

Definīcijas

Šajā regulā piemēro šādas definīcijas:

- 1) "paketes darījums" ir jebkurš šāds darījums:
- a) tāds darījums ar atvasināto instrumentu līgumu vai citu finanšu instrumentu, kas saistīts ar darījuma ar līdzvērtīga daudzuma bāzes fizisko aktīvu vienlaicīgu izpildi (apmaiņa ar fiziskiem līdzekļiem jeb *EFP*);
 - b) darījums, kas ietver divu vai vairāku komponentdarījumu ar finanšu instrumentiem izpildi un:
 - i) ko izpilda starp diviem vai vairākiem darījumu partneriem;
 - ii) kurā katra darījuma komponente ir saistīta ar nozīmīgu ekonomisko vai finansiālo risku saistībā ar visām pārējām komponentēm;
 - iii) kurā katras komponentes izpilde ir vienlaicīga un atkarīga no visu pārējo komponentu izpildes;
- 2) "cenu piedāvājumu pieprasīšanas sistēma" ir tirdzniecības sistēma, kurā ir izpildīti šādi nosacījumi:
- a) locekļa vai dalībnieka cenu piedāvājumu vai cenu piedāvājumus sniedz, atbildot uz cenu piedāvājumu pieprasījumu, ko iesniedzis viens vai vairāki citi locekļi vai dalībnieki;

⁽¹⁾ Komisijas 2016. gada 14. jūlija Deleģētā regula (ES) 2017/585, ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 600/2014 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par finanšu instrumentu atsaucē datu standartiem un formātiem un tehniskiem līdzekļiem saistībā ar Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādes un kompetento iestāžu veicamajiem pasākumiem (skatīt šā Oficiālā Vēstneša 368. lappusi).

⁽²⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2010. gada 24. novembra Regula (ES) Nr. 1095/2010, ar ko izveido Eiropas Uzraudzības iestādi (Eiropas Vērtspapīru un tirgu iestādi), groza Lēmumu Nr. 716/2009/EK un atceļ Komisijas Lēmumu 2009/77/EK (OV L 331, 15.12.2010., 84. lpp.).

- b) cenu piedāvājumu var izpildīt vienīgi pieprasījumu iesniegušais loceklis vai dalībnieks;
 - c) pieprasījumu iesniegušais loceklis vai tirgus dalībnieks var noslēgt darījumu, pieņemot cenu piedāvājumu vai cenu piedāvājumus, kas tam sniegti pēc pieprasījuma;
- 3) "balss tirdzniecības sistēma" ir tirdzniecības sistēma, kurā darījumi starp dalībniekiem tiek kārtoti balss sarunu veidā.

II NODAĻA

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

2. pants

Pirmstirdzniecības pārredzamības pienākumi

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

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

3. pants

Apjomīgi rīkojumi

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

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

4. pants

Rīkojumu pārvaldības sistēmā turēto rīkojumu veids un minimālais apjoms

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

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

- a) ko ir plānots atklāt rīkojumu reģistrā, ko uztur attiecīgā tirdzniecības vieta un kas ir atkarīgs no objektīviem apstākļiem, kuri ir iepriekš noteikti sistēmas protokolā;
- b) kas nav saistīts ar citām tirdzniecības interesēm pirms atklāšanas tirdzniecības vietas rīkojumu reģistrā;
- c) kas, tiklīdz atklāts rīkojumu reģistrā, ir saistīts ar citiem rīkojumiem saskaņā ar attiecīgā veida rīkojumiem informācijas atklāšanas laikā piemērojamajiem noteikumiem.

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

- a) rezerves rīkojuma apjoms ir EUR 10 000 vai lielāks;
- b) attiecībā uz pārējiem rīkojumiem apjoms ir vienāds ar minimālo tirgojamo daudzumu, ko iepriekš noteicis sistēmas operators saskaņā ar saviem noteikumiem un protokoliem, vai lielāks par to.

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

5. pants

Konkrētam finanšu instrumentam raksturīgs apjoms

(Regulas (ES) Nr. 600/2014 8. panta 4. punkts un 9. panta 1. punkta b) apakšpunkts)

1. Izmantojama norāde par interesi pārsniedz konkrētam finanšu instrumentam raksturīgu apjomu, ja tā reģistrēšanas brīdī vai pēc jebkura grozījuma izdarīšanas tajā, minētais apjoms ir līdzvērtīgs izmantojamās norādes par interesi minimālajam apjomam, ko nosaka saskaņā ar 13. pantā noteikto metodi, vai lielāks par to.
2. Orientējošas pirmstirdzniecības cenas izmantojamām norādēm par interesi, kas pārsniedz konkrētam finanšu instrumentam raksturīgu apjomu, kas noteikts saskaņā ar 1. punktu un ir mazāks nekā attiecīgais daudzums rīkojumiem, kas lieli pēc apjoma, kas noteikts saskaņā ar 3. pantu, uzskata par tuvām tirdzniecības interešu cenām, ja tirdzniecības vieta publicē kādu no turpmāk minētajiem:
 - a) labākā pieejamā cena;
 - b) cenu vienkāršais vidējais rādītājs;
 - c) vidējā cena, kura svērta, pamatojoties uz izmantojamo norāžu par interesi apjomu, cenu, laiku vai skaitu.
3. Tirgus uzturētāji un ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas uztur tirdzniecības vietu, publicē pirmstirdzniecības cenu aprēķināšanas metodi un publicēšanas vietu, reģistrējot un atjauninot orientējošās pirmstirdzniecības cenas.

6. pants

Finanšu instrumentu klases, kurām nav likvīda tirgus

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

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

III NODAĻA

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

7. pants

Pēctirdzniecības pārredzamības pienākumi

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

1. Ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas veic tirdzniecību, neievērojot tirdzniecības vietas noteikumus, un tirgus uzturētāji un ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas uztur tirdzniecības vietu, atsaucoties uz katru darījumu, publicē informāciju, kas noteikta II pielikuma 1. un 2. tabulā, un izmanto II pielikuma 3. tabulā uzskaitīto katru piemērojamo karodziņu.
2. Ja tiek atcelts iepriekš publicēts ziņojums par tirdzniecību, ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas veic tirdzniecību ārpus tirdzniecības vietas, un tirgus uzturētāji un ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas uztur tirdzniecības vietu, publicē jaunu ziņojumu par tirdzniecību, kas ietver visu sākotnējā tirdzniecības ziņojumā ietverto informāciju un II pielikuma 3. tabulā precizēto atcelšanas karodziņu.
3. Ja tiek veiktas izmaiņas iepriekš publicētā ziņojumā par tirdzniecību, ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas veic tirdzniecību ārpus tirdzniecības vietas, un tirgus uzturētāji un ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas uztur tirdzniecības vietu, publicē šādu informāciju:
 - a) jauns ziņojums par tirdzniecību, kas ietver visu sākotnējā tirdzniecības ziņojumā ietverto informāciju, un atcelšanas karodziņš, kā precizēts II pielikuma 3. tabulā;
 - b) jauns ziņojums par tirdzniecību, kas ietver visu sākotnējā tirdzniecības ziņojumā ietverto informāciju ar visu nepieciešamo laboto informāciju, un grozījumu karodziņš, kā precizēts II pielikuma 3. tabulā.

4. Pēctirdzniecības informāciju dara pieejamu iespējami tuvāk reāllaikam, cik vien tehniski iespējams, un jebkurā gadījumā:
- a) pirmajos trīs gados no Regulas (ES) Nr. 600/2014 piemērošanas dienas 15 minūšu laikā pēc attiecīgā darījuma izpildes;
 - b) pēc tam 5 minūšu laikā pēc attiecīgā darījuma izpildes.
5. Ja tirdzniecību starp abām ieguldījumu brokeru sabiedrībām veic, neievērojot tirdzniecības vietas noteikumus, pašu vārdā vai klientu vārdā, tikai tā ieguldījumu brokeru sabiedrība, kas pārdod attiecīgo finanšu instrumentu, publicē konkrēto darījumu, izmantojot APS.
6. Atkāpjoties no 5. punkta, ja tikai viena no ieguldījumu brokeru sabiedrībām, kas ir darījuma puse, ir sistēmiskais internalizētājs konkrētajam finanšu instrumentam un rīkojas kā sabiedrība, kas to iegādājas, tikai šāda sabiedrība darījumu publicē, izmantojot APS, par izdarīto informējot pārdevēju.
7. Ieguldījumu brokeru sabiedrības veic visus saprātīgos pasākumus, lai nodrošinātu, ka darījums tiek darīts publiski pieejams kā viens darījums. Šim mērķim divi sapāroti darījumi, kas iegrāmatoti vienlaikus par to pašu cenu vienam un tam pašam darījuma partnerim, uzskatāmi par vienu darījumu.
8. Informāciju, kas attiecas uz paketes darījumu, dara pieejamu attiecībā uz katru komponenti iespējami tuvāk reāllaikam, cik vien tehniski iespējams, ņemot vērā vajadzību piešķirt cenas konkrētiem finanšu instrumentiem, un tā ietver paketes darījuma karodziņu vai karodziņu, kas norāda apmaiņu ar fiziskiem līdzekļiem, kā precizēts II pielikuma 3. tabulā. Ja paketes darījums ir atbilstīgs atlikai publicēšanai saskaņā ar 8. pantu, informāciju par visām komponentēm dara pieejamu pēc tam, kad ir beidzies attiecīgā darījuma atlikšanas laikposms.

8. pants

Darījumu atlikta publicēšana

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

1. Ja kompetentā iestāde atļauj veikt darījumu informācijas atliktu publicēšanu saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 1. punktu, ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas veic tirdzniecību ārpus tirdzniecības vietas, un tirgus uzturētāji un ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas uztur tirdzniecības vietu, publicē katru darījumu ne vēlāk kā 19:00 pēc vietējā laika otrajā darbdienā pēc attiecīgā darījuma noslēgšanas dienas, ja ir izpildīts viens no šādiem nosacījumiem:
- a) darījums ir liels pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, kā precizēts 9. pantā;
 - b) darījums ir veikts ar finanšu instrumentu vai finanšu instrumentu klasi, kurai nav likvīda tirgus, kā ir norādīts saskaņā ar 13. pantā noteikto metodi;
 - c) darījums ir noslēgts starp ieguldījumu brokeru sabiedrību, kas rīkojas savā vārdā, nevis pēc sapārotas tirdzniecības principa, kā noteikts Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2014/65/ES ⁽¹⁾ 4. panta 1. punkta 38) apakšpunktā, un citu darījumu partneri un pārsniedz attiecīgajam instrumentam raksturīgo apjomu, kā precizēts 10. pantā;
 - d) darījums ir paketes darījums, kas atbilst vienam no šādiem kritērijiem:
 - i) viena vai vairākas no tā komponentēm ir darījumi ar finanšu instrumentiem, kuriem nav likvīda tirgus;
 - ii) viena vai vairākas no tā komponentēm ir darījumi ar finanšu instrumentiem, kas ir lieli pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, kā noteikts 9. pantā;
 - iii) darījums ir noslēgts starp ieguldījumu brokeru sabiedrību, kas rīkojas savā vārdā, nevis pēc sapārotas tirdzniecības principa, kā noteikts Direktīvas 2014/65/ES 4. panta 1. punkta 38) apakšpunktā, un citu darījumu partneri, un viena vai vairākas tā komponentes ir darījumi ar finanšu instrumentiem, kas pārsniedz attiecīgajam instrumentam raksturīgo apjomu, kā noteikts 10. pantā.

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

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

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

9. pants

Darījumi, kas ir lieli pēc apjoma

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

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

10. pants

Konkrētam finanšu instrumentam raksturīgs apjoms

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

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

11. pants

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

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

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

- a) ja piemēro Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkta a) apakšpunktu, kompetentās iestādes pieprasa, lai visu atlikšanas laikposmu, kas minēts 8. pantā, tiek publicēta šāda informācija:
 - i) visa informācija par darījumu, kas noteikta II pielikuma 1. un 2. tabulā, izņemot informācija par apjomu;
 - ii) vai darījumi dienas apkopotā formātā, kas ietver vismaz 5 darījumus, kas izpildīti tajā pašā dienā, kas jāpublicē nākamajā darbdienā līdz 9:00 pēc vietējā laika.
- b) ja piemēro Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkta b) apakšpunktu, kompetentās iestādes ļauj nublicēt atsevišķa darījuma apjomu četru nedēļu pagarinātā laikposmā;
- c) attiecībā uz instrumentiem, kas nav kapitāla vērtspapīru finanšu instrumenti, kas nav valsts parāds, un ja piemēro Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkta c) apakšpunktu, kompetentās iestādes uz četru nedēļu pagarinātu laikposmu ļauj atlikt vairāku darījumu apkopojuma publicēšanu, kuri izpildīti vienas kalendārās nedēļas laikā, nākamajā otrdienā līdz 9:00 pēc vietējā laika;
- d) attiecībā uz valsts parāda instrumentiem un ja piemēro Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkta d) apakšpunktu, kompetentās iestādes uz nenoteiktu laiku ļauj publicēt vairāku darījumu apkopojumu, kuri izpildīti vienas kalendārās nedēļas laikā, nākamajā otrdienā līdz 9:00 pēc vietējā laika.

2. Ja ir beidzies 1. punkta b) apakšpunktā noteiktais atliktā laikposma pagarinājums, piemēro šādas prasības:
- a) attiecībā uz instrumentiem, kas nav valsts parāds, publicē visu informāciju par katru atsevišķu darījumu nākamajā darbdiēnā līdz 9:00 pēc vietējā laika;
 - b) attiecībā uz valsts parāda instrumentiem gadījumos, kad kompetentās iestādes izlemj neizmantot Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkta b) un d) apakšpunktā nodrošinātās iespējas pēc kārtas, visu informāciju par katru atsevišķu darījumu saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkta otro daļu publicē nākamajā darbdiēnā līdz 9:00 pēc vietējā laika;
 - c) attiecībā uz valsts parāda instrumentiem gadījumos, kad kompetentās iestādes izlemj izmantot Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkta b) un d) apakšpunktā nodrošinātās iespējas pēc kārtas, apkopotu informāciju par vairākiem darījumiem, kas izpildīti tajā pašā kalendārajā nedēļā, saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 11. panta 3. punkta otro daļu publicē nākamajā otrdiēnā, kas seko pēc četru nedēļu pagarinātā atlikšanas laikposma beigām, skaitot no minētās kalendārās nedēļas pēdējās dienas līdz 9:00 pēc vietējā laika.
3. Attiecībā uz visiem instrumentiem, kas nav valsts parāds, visu informāciju par atsevišķiem darījumiem publicē četras nedēļas pēc tam, kad publicēta apkopotā informācija, saskaņā ar 1. punkta c) apakšpunktu līdz 9:00 pēc vietējā laika.
4. Šā panta 1. un 2. punktā minētā apkopotā informācija ietver turpmāk norādīto informāciju attiecībā uz obligācijām, strukturētā finansējuma produktiem, atvasinātajiem instrumentiem un emisijas kvotām attiecībā uz konkrētā kalendārā laikposma katru dienu vai nedēļu:
- a) vidējā svērtā cena;
 - b) tirgoto darījumu kopapjoms, kā minēts II pielikuma 4. tabulā;
 - c) darījumu kopskaits.
5. Darījumus apkopo pēc ISIN koda. Ja ISIN kods nav pieejams, darījumus apkopo tās finanšu instrumentu kategorijas līmenī, kurai piemēro 13. pantā paredzēto likviditātes testu.
6. Ja publicēšanai paredzētā nedēļas diena, kas noteikta 1. punkta c) un d) apakšpunktā un 2. un 3. punktā, nav darbdiēna, publicēšanu veic nākamajā darbdiēnā līdz 9:00 pēc vietējā laika.

12. pants

Pēctirdzniecības pārredzamības piemērošana konkrētiem darījumiem, kas izpildīti ārpus tirdzniecības vietas

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

Pienākumu publicēt darījumu apjomu un cenu un laiku, kurā tie tika noslēgti, kā noteikts Regulas (ES) Nr. 600/2014 21. panta 1. punktā, nepiemēro šādiem darījumiem:

- a) darījumiem, kas uzskaitīti Komisijas Deleģētās regulas (ES) 2017/590 ⁽¹⁾ 2. panta 5. punktā;
- b) darījumiem, ko veikusi pārvaldības sabiedrība, kā definēts Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2009/65/EK ⁽²⁾ 2. panta 1. punkta b) apakšpunktā, vai alternatīvo ieguldījumu fondu pārvaldnieks, kā definēts Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2011/61/ES ⁽³⁾ 4. panta 1. punkta b) apakšpunktā, kas akciju faktiskās īpašumtiesības no viena kolektīvo ieguldījumu uzņēmuma nodod citam, un neviena no ieguldījumu brokeru sabiedrībām nav konkrētā darījuma puse;

⁽¹⁾ Komisijas 2016. gada 28. jūlija Deleģētā regula (ES) 2017/590, ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 600/2014 attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem ziņošanai par darījumiem kompetentajām iestādēm (skatīt šā *Oficiālā Vēstneša* 449. lappusi).

⁽²⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2009. gada 13. jūlija Direktīva 2009/65/EK par normatīvo un administratīvo aktu koordināciju attiecībā uz pārvedamu vērtspapīru kolektīvo ieguldījumu uzņēmumiem (PVKIU) (OV L 302, 17.11.2009., 32. lpp.).

⁽³⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2011. gada 8. jūnija Direktīva 2011/61/ES par alternatīvo ieguldījumu fondu pārvaldniekiem un par grozījumiem Direktīvā 2003/41/EK, Direktīvā 2009/65/EK, Regulā (EK) Nr. 1060/2009 un Regulā (ES) Nr. 1095/2010 (OV L 174, 1.7.2011., 1. lpp.).

- c) "pastarpināts darījums" (*give-up transaction*), kas ir darījums, kurā ieguldījumu brokeru sabiedrība nodod klienta darījumu citai ieguldījumu brokeru sabiedrībai vai saņem no tās klienta darījumu, lai veiktu tā pēctirdzniecības apstrādi;
- d) darījumiem, kuros finanšu instrumenti tiek nodoti kā nodrošinājums divpusējos darījumos vai saistībā ar centrālā darījuma partnera (CCP) drošības rezervi vai nodrošinājuma prasībām vai CCP saistību neizpildes pārvaldības procedūras ietvaros.

IV NODAĻA

PIRMSTIRDZNIECĪBAS UN PĒCTIRDZNIECĪBAS PĀRREDZAMĪBAI KOPĪGIE NOTEIKUMI

13. pants

Metode pārredzamības aprēķinu veikšanai

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

1. Lai noteiktu finanšu instrumentus vai finanšu instrumentu klases, kurām nav likvīda tirgus, 6. panta un 8. panta 1. punkta b) apakšpunkta nolūkos, aktīvu klasēm piemēro šādas metodes:
 - a) stabili nosakot likviditāti:
 - i) vērtspapīroto atvasināto instrumentu aktīvu klasei, kā definēts III pielikuma 4.1. tabulā;
 - ii) kapitāla vērtspapīru atvasināto instrumentu šādām aktīvu apakšklasēm: akciju indeksa iespējas līgumi, akciju indeksa regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi, akciju iespējas līgumi, regulētā tirgū tirgoti/regulētā tirgū netirgoti akciju nākotnes līgumi, akciju dividenžu iespējas līgumi, akciju dividenžu regulētā tirgū tirgoti/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi, dividenžu indeksa iespējas līgumi, dividenžu indeksa regulētā tirgū tirgoti/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi, svārstīguma indeksa iespējas līgumi, svārstīguma indeksa regulētā tirgū tirgoti/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi, biržā tirgotu fondu iespējas līgumi, biržā tirgotu fondu regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi un citi kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti, kā noteikts III pielikuma 6.1. tabulā;
 - iii) ārvalstu valūtas atvasināto instrumentu aktīvu klasei, kā definēts III pielikuma 8.1. tabulā;
 - iv) citu procentu likmju atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasēm, citiem preču atvasinātiem instrumentiem, citiem kredītu atvasinātajiem instrumentiem, citiem C10 atvasinātajiem instrumentiem, citiem līgumiem par cenu starpībām, citām emisijas kvotām un citiem emisijas kvotu atvasinātajiem instrumentiem, kā definēts III pielikuma 5.1., 7.1., 9.1., 10.1., 11.1., 12.1. un 13.1. tabulā.
 - b) veicot periodisku novērtējumu, pamatojoties uz kvantitatīviem un, ja piemērojams, kvalitatīviem likviditātes kritērijiem, par
 - i) visiem obligāciju veidiem, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes, kā definēts III pielikuma 2.1. tabulā, un kā turpmāk precizēts 17. panta 1. punktā;
 - ii) biržā tirgotu preču un biržā tirgotu parādzīmju obligāciju veidiem, kā definēts III pielikuma 2.4. tabulā;
 - iii) procentu likmju atvasināto instrumentu aktīvu klasei, izņemot citu procentu likmju atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasi, kā definēts III pielikuma 5.1. tabulā;
 - iv) šādām kapitāla vērtspapīru atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasēm: mijmaiņas darījumiem un portfeļa mijmaiņas darījumiem, kā definēts III pielikuma 6.1. tabulā;
 - v) preču atvasināto instrumentu aktīvu klasei, izņemot citu preču atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasi, kā definēts III pielikuma 7.1. tabulā;
 - vi) šādām kredītu atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasēm: indeksa kredītriska mijmaiņas līgumiem un ar vienu parādznieku saistīta kredītriska mijmaiņas līgumiem, kā definēts III pielikuma 9.1. tabulā;
 - vii) C10 atvasināto instrumentu aktīvu klasei, izņemot citu C10 atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasi, kā definēts III pielikuma 10.1. tabulā;
 - viii) šādām līgumu par cenu starpībām aktīvu apakšklasēm: līgumiem par valūtas cenu starpībām un līgumiem par preču cenu starpībām, kā definēts III pielikuma 11.1. tabulā;

- ix) emisijas kvotu aktīvu klasei, izņemot citu emisijas kvotu aktīvu apakšklasi, kā definēts III pielikuma 12.1. tabulā;
 - x) emisijas kvotu atvasināto instrumentu aktīvu klasei, izņemot citu emisijas kvotu atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasi, kā definēts III pielikuma 13.1. tabulā.
- c) Veicot periodisku novērtējumu, pamatojoties uz kvalitatīviem likviditātes kritērijiem, par
- i) šādām kredītu atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasēm: kredītriska mijmaiņas darījuma indeksa iespējas līgumiem un ar vienu parādnieku saistīta kredītriska mijmaiņas darījumu iespējas līgumiem, kā definēts III pielikuma 9.1. tabulā;
 - ii) šādām līgumu par cenu starpībām aktīvu apakšklasēm: līgumi par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām, līgumi par obligāciju cenu starpībām, līgumi par cenu starpībām par regulētā tirgū tirgotu kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumu /regulētā tirgū netirgotu kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumu un līgumi par cenu starpībām par kapitāla vērtspapīru iespējas līgumu, kā definēts III pielikuma 11.1. tabulā.
- d) Veicot periodisku novērtējumu, pamatojoties uz divu pārbažu metodi strukturētā finansējuma produktiem, kā definēts III pielikuma 3.1. tabulā.
2. Lai noteiktu konkrētam finanšu instrumentam raksturīgu apjomu, kā minēts 5. pantā, un rīkojumus, kuri ir lieli pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, kā minēts 3. pantā, piemēro šādas metodes:
- a) robežvērtības vērtība:
- i) biržā tirgotu preču un biržā tirgotu parādzīmju obligāciju veidiem, kā definēts III pielikuma 2.5. tabulā;
 - ii) vērtspapīroto atvasināto instrumentu aktīvu klasei, kā definēts III pielikuma 4.2. tabulā;
 - iii) katrai kapitāla vērtspapīru atvasināto instrumentu apakšklasei, kā noteikts III pielikuma 6.2. un 6.3. tabulā;
 - iv) katrai ārvalstu valūtas atvasināto instrumentu apakšklasei, kā definēts III pielikuma 8.2. tabulā;
 - v) katrai apakšklasei, par kuru uzskata, ka tai nav likvīda tirgus procentu likmju atvasināto instrumentu, preču atvasināto instrumentu, kredītu atvasināto instrumentu, C10 atvasināto instrumentu un cenu starpības līgumu aktīvu klasēm, kā definēts III pielikuma 5.3., 7.3., 9.3., 10.3. un 11.3. tabulā;
 - vi) katrai aktīvu apakšklasei, par kuru uzskata, ka tai nav likvīda tirgus emisijas kvotu un emisijas kvotu atvasināto instrumentu aktīvu klasēm, kā definēts III pielikuma 12.3. un 13.3. tabulā;
 - vii) katram strukturētā finansējuma produktam, ja nav nokārtota 1. punkta d) apakšpunktā minētā pārbaude (*Test-1*), kā definēts III pielikuma 3.2. tabulā;
 - viii) katram strukturētā finansējuma produktam, par kuru uzskata, ka tam nav likvīda tirgus, ja ir nokārtota tikai 1. punkta d) apakšpunktā minētā pārbaude (*Test-1*), kā definēts III pielikuma 3.3. tabulā.
- b) lielākais no tirdzniecības apjomiem, kas pārsniedz to darījumu procentuālo skaitu, kas atbilst tirdzniecības procentilim, kā turpmāk precizēts 17. panta 3. punktā, un robežvērtības vērtība
- i) katram obligāciju veidam, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes, kā definēts III pielikuma 2.3. tabulā;
 - ii) katrai apakšklasei, kurai ir likvīds tirgus procentu likmju atvasināto instrumentu, preču atvasināto instrumentu, kredītu atvasināto instrumentu, C10 atvasināto instrumentu un līgumu par cenu starpībām aktīvu klasēm, kā definēts III pielikuma 5.2., 7.2., 9.2., 10.2. un 11.2. tabulā;
 - iii) katrai aktīvu apakšklasei, kurai ir likvīds tirgus emisijas kvotu un emisijas kvotu atvasināto instrumentu aktīvu klasēm, kā definēts III pielikuma 12.2. un 13.2. tabulā;
 - iv) katram strukturētā finansējuma produktam, par kuru uzskata, ka tam ir likvīds tirgus, ja ir nokārtotas 1. punkta d) apakšpunktā minētās pārbaudes (*Test-1* un *Test-2*), kā definēts III pielikuma 3.3. tabulā.
3. Lai noteiktu konkrētam finanšu instrumentam raksturīgu apjomu, kā minēts 8. panta 1. punkta c) apakšpunktā, un darījumus, kas ir lieli pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, kā minēts 8. panta 1. punkta a) apakšpunktā, piemēro šādas metodes:
- a) robežvērtības vērtība:
- i) biržā tirgotu preču un biržā tirgotu parādzīmju obligāciju veidiem, kā definēts III pielikuma 2.5. tabulā;
 - ii) vērtspapīroto atvasināto instrumentu aktīvu klasei, kā definēts III pielikuma 4.2. tabulā;

- iii) katrai kapitāla vērtspapīru atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasei, kā noteikts III pielikuma 6.2. un 6.3. tabulās;
 - iv) katrai ārvalstu valūtas atvasināto instrumentu apakšklasei, kā definēts III pielikuma 8.2. tabulā;
 - v) katrai apakšklasei, par kuru uzskata, ka tai nav likvīda tirgus procentu likmju atvasināto instrumentu, preču atvasināto instrumentu, kredītu atvasināto instrumentu, C10 atvasināto instrumentu un līgumu par cenu starpībām aktīvu klasēm, kā definēts III pielikuma 5.3., 7.3., 9.3., 10.3. un 11.3. tabulā;
 - vi) katrai aktīvu apakšklasei, par kuru uzskata, ka tai nav likvīda tirgus emisijas kvotu un emisijas kvotu atvasināto instrumentu aktīvu klasēm, kā definēts III pielikuma 12.3. un 13.3. tabulā;
 - vii) katram strukturētā finansējuma produktam, ja nav nokārtota 1. punkta d) apakšpunktā minētā pārbaude (*Test-1*), kā definēts III pielikuma 3.2. tabulā;
 - viii) katram strukturētā finansējuma produktam, par kuru uzskata, ka tam nav likvīda tirgus, ja ir nokārtota tikai 1. punkta d) apakšpunktā minētā pārbaude (*Test-1*), kā definēts III pielikuma 3.3. tabulā;
- b) tirdzniecības apjoms, kas pārsniedz to darījumu procentuālo skaitu, kas atbilst katra obligāciju veida, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes, tirdzniecības procentīlei, kā definēts III pielikuma 2.3. tabulā;
- c) lielākais no tirdzniecības apjomiem, kas pārsniedz to darījumu procentuālo skaitu, kas atbilst tirdzniecības procentīlei, tirdzniecības apjoms, kas pārsniedz to darījumu procentuālo skaitu, kas atbilst apjoma procentīlei, un robežvērtība katrai apakšklasei, par kuru uzskata, ka tai ir likvīds tirgus procentu likmju atvasināto instrumentu, preču atvasināto instrumentu, kredītu atvasināto instrumentu, C10 atvasināto instrumentu un līgumu par cenu starpībām aktīvu klasēm, kā noteikts III pielikuma 5.2., 7.2., 9.2., 10.2. un 11.2. tabulā;
- d) lielākais no tirdzniecības apjomiem, kas pārsniedz to darījumu procentuālo skaitu, kas atbilst tirdzniecības procentīlei, un robežvērtība
- i) katrai aktīvu apakšklasei, par kuru uzskata, ka tai ir likvīds tirgus emisijas kvotu un emisijas kvotu atvasināto instrumentu aktīvu klasēm, kā noteikts III pielikuma 12.2. un 13.2. tabulā;
 - ii) katram strukturētā finansējuma produktam, par kuru uzskata, ka tam ir likvīds tirgus, ja ir nokārtotas 1. punkta d) apakšpunktā minētās pārbaudes (*Test-1* un *Test-2*), kā definēts III pielikuma 3.3. tabulā.
4. Šā panta 3. punkta c) apakšpunkta vajadzībām, ja tirdzniecības apjoms, kas atbilst apjoma procentīlei, lai noteiktu darījumu, kas ir liels pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, ir lielāks par 97,5 tirdzniecības procentīli, tirdzniecības apjomu ņem vērā, un konkrētam finanšu instrumentam raksturīgu apjomu, kā minēts 8. panta 1. punkta c) apakšpunktā, un to darījumu apjomu, kuri ir lieli pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, kā minēts 8. panta 1. punkta a) apakšpunktā, nosaka kā lielāko no tirdzniecības apjomiem, kas pārsniedz to darījumu procentuālo skaitu, kas atbilst tirdzniecības procentīlei un minimālajai robežvērtībai.
5. Saskaņā ar Deleģētajām regulām (ES) 2017/590 un (ES) 2017/577 kompetentās iestādes katru dienu apkopo datus no tirdzniecības vietām, apstiprinātām publicēšanas struktūrām un konsolidētu datu lentes nodrošinātājiem, kas ir nepieciešams aprēķinu veikšanai, lai noteiktu:
- a) finanšu instrumentus un finanšu instrumentu klases, kurām nav likvīda tirgus, kā noteikts 1. punktā;
 - b) lielus apjomus salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu un konkrētam instrumentam raksturīgu apjomu, kā noteikts 2. un 3. punktā.
6. Kompetentās iestādes, kas veic aprēķinus finanšu instrumentu klasei, izveido savstarpējus sadarbības pasākumus, lai nodrošinātu aprēķiniem nepieciešamo datu apkopošanu visā Savienībā.
7. Šā panta 1. punkta b) un d) apakšpunkta, 2. punkta b) apakšpunkta un 3. punkta b), c) un d) apakšpunkta vajadzībām kompetentās iestādes ņem vērā darījumus, kas izpildīti Savienībā no iepriekšējā gada 1. janvāra līdz 31. decembrim.

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

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

10. Šā panta 2. punkta b) apakšpunkta i) punktā un 3. punkta b) apakšpunktā minētie aprēķini neietver darījumus, kuru apjoms ir līdzvērtīgs EUR 100 000 vai mazāks par to.

11. Šā panta 2. un 3. punktā noteiktajiem apjomiem nepiemēro 2. punkta b) apakšpunktu un 3. punkta b), c) un d) apakšpunktu, ja aprēķinos vērā ņemto darījumu skaits nepārsniedz 1 000, un šādā gadījumā piemēro turpmāk norādītās robežvērtības:

a) EUR 100 000 visiem obligāciju veidiem, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes;

b) Šā panta 2. punkta a) apakšpunktā un 3. punkta a) apakšpunktā definētās robežvērtības visiem finanšu instrumentiem, kam nepiemēro šā punkta a) apakšpunktu.

12. Izņemot, ja tie attiecas uz emisijas kvotām vai to atvasinātajiem instrumentiem, 2. punkta b) apakšpunktā un 3. punkta b), c) un d) apakšpunkta minētos aprēķinus noapaļo šādi:

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

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

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

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

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

14. Attiecībā uz kapitāla vērtspapīru atvasinātajiem instrumentiem, kurus atļauts tirgot vai kurus pirmoreiz tirgo tirdzniecības vietā, kuri nepieder apakšklasei, attiecībā uz kuru ir publicēts 5. pantā un 8. panta 1. punkta c) apakšpunktā minētais konkrētam finanšu instrumentam raksturīgais apjoms un rīkojumu un tādu darījumu apjoms, kas ir lieli pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, kā minēts 3. pantā un 8. panta 1. punkta a) apakšpunktā, un kuri pieder kādai no 1. punkta a) apakšpunkta ii) punktā precizētajai aktīvu apakšklasei, konkrētam finanšu instrumentam raksturīgs apjoms un rīkojumu un tādu darījumu apjoms, kas ir lieli pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, ir apjoms, ko piemēro tādas aktīvu apakšklases vismazākās joslas vidējai dienas nosacītajai summai (ADNA), kurai pieder kapitāla vērtspapīru atvasinātais instruments.

15. Attiecībā uz finanšu instrumentiem, kurus atļauts tirgot vai kurus pirmoreiz tirgo tirdzniecības vietā, kuri nepieder nevienai apakšklasei, attiecībā uz kuru ir publicēts 5. pantā un 8. panta 1. punkta c) apakšpunktā minētais konkrētam finanšu instrumentam raksturīgais apjoms un rīkojumu un tādu darījumu apjoms, kas ir lieli pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, kā minēts 3. pantā un 8. panta 1. punkta a) apakšpunktā, uzskata, ka tiem nav likvīda tirgus, līdz ir piemēroti saskaņā ar 17. punktu veikto aprēķinu rezultāti. Piemērojamais 5. pantā un 8. panta 1. punkta c) apakšpunktā minētais konkrētam finanšu instrumentam raksturīgais apjoms un rīkojumu un tādu darījumu apjoms, kas ir lieli pēc apjoma salīdzinājumā ar parasto tirgus apjomu, kā minēts 3. pantā un 8. panta 1. punkta a) apakšpunktā, ir to apakšklašu apjoms, par kurām ir noteikts, ka tām nav likvīda tirgus un kuras pieder pie tās pašas aktīvu apakšklases.

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

17. Kompetentās iestādes nodrošina, ka tiek publicēti 5. punktā minētie aprēķinu rezultāti par katru finanšu instrumentu un finanšu instrumentu klasi līdz 30. aprīlim gadā, kas seko pēc Regulas (ES) Nr. 600/2014 piemērošanas dienas, un pēc tam līdz katra gada 30. aprīlim. Aprēķinu rezultātus piemēro no 1. jūnija katru gadu pēc publicēšanas.

18. Šā panta 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā minēto aprēķinu nolūkā un atkāpjoties no 7., 15. un 17. punkta, kompetentās iestādes attiecībā uz obligācijām, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes, nodrošina, ka tiek publicēti 5. punkta a) apakšpunktā minētie aprēķini ik ceturksni februāra, maija, augusta un novembra pirmajā dienā pēc Regulas (ES) Nr. 600/2014 piemērošanas dienas un pēc tam katra gada februāra, maija, augusta un novembra pirmajā dienā. Aprēķini ietver darījumus, kas izpildīti Savienībā iepriekšējā gada ceturksnī, un attiecas uz 3 mēnešu laikposmu, kas sākas katra gada februāra, maija, augusta un novembra sešpadsmitajā dienā.

19. Attiecībā uz obligācijām, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes, kuras atļauts tirgot vai kuras tiek pirmoreiz tirgotas tirdzniecības vietā, ceturkšņa pirmajos divos mēnešos uzskata, ka tām nav likvida tirgus, kā precizēts III pielikuma 2.2. tabulā, līdz tiek piemēroti kalendārā ceturkšņa aprēķinu rezultāti.

20. Attiecībā uz obligācijām, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes, kuras atļauts tirgot vai kuras tiek pirmoreiz tirgotas tirdzniecības vietā, ceturkšņa pēdējā mēnesī uzskata, ka tām nav likvida tirgus, kā precizēts III pielikuma 2.2. tabulā, līdz tiek piemēroti nākamā kalendārā ceturkšņa aprēķinu rezultāti.

14. pants

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

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

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

- a) darījumu veic monetārās politikas nolūkā, tostarp operācija, kas veikta saskaņā ar Eiropas Centrālo banku sistēmas un Eiropas Centrālās bankas Statūtu, kas pievienoti Līgumam par Eiropas Savienību, 18. un 20. pantu, vai operācija, kas veikta saskaņā ar valsts tiesību normām ECBS dalībniekiem dalībvalstīs, kuru valūta nav euro;
- b) darījums ir operācija ar valūtas maiņas kursu, tostarp operācijas, kas veiktas, lai turētu vai pārvaldītu dalībvalstu oficiālās ārvalstu valūtas rezerves, vai rezervju pārvaldības pakalpojums, ko sniedz ECBS dalībnieks centrālajām bankām citās valstīs, attiecībā uz kurām ir pagarināts atbrīvojums saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 1. panta 9. punktu;
- c) darījumu veic finanšu stabilitātes politikas nolūkā.

15. pants

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

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

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

- a) darījumi, kas noslēgti, lai pārvaldītu pašu kapitālu;
- b) darījumi, kas noslēgti administratīvos nolūkos vai ECBS dalībnieka darbiniekam, tostarp darījumi, kurus veicis darbinieku pensiju shēmas pārvaldnieks;
- c) darījumi, kas noslēgti savam ieguldījumu portfelim saskaņā ar pienākumiem, kas noteikti valsts tiesību aktos.

16. pants

Pārredzamības pienākumu pagaidu apturēšana

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

1. Attiecībā uz finanšu instrumentiem, kuriem ir likvids tirgus saskaņā ar 13. pantā izklāstīto metodi, kompetentā iestāde var uz laiku apturēt Regulas (ES) Nr. 600/2014 8. un 10. pantā minētos pienākumus, ja attiecībā uz obligāciju, strukturētā finansējuma produktiem, emisijas kvotām vai atvasinātajiem instrumentiem kopapjoms, kā definēts II pielikuma 4. tabulā, kas aprēķināts par iepriekšējām 30 kalendārajām dienām, ir mazāk nekā 40 % no vidējā mēneša apjoma, kas aprēķināts par 12 pilniem kalendārajiem mēnešiem, kuriem seko minētās 30 kalendārās dienas.
2. Attiecībā uz finanšu instrumentiem, kuriem nav likvida tirgus saskaņā ar 13. pantā izklāstīto metodi, kompetentā iestāde var uz laiku apturēt Regulas (ES) Nr. 600/2014 8. un 10. pantā minētos pienākumus, ja attiecībā uz obligāciju klasi, strukturētā finansējuma produktiem, emisijas kvotām vai atvasinātajiem instrumentiem kopapjoms, kā definēts II pielikuma 4. tabulā, kas aprēķināts par iepriekšējām 30 kalendārajām dienām, ir mazāk nekā 20 % no vidējā mēneša apjoma, kas aprēķināts par 12 pilniem kalendārajiem mēnešiem, kuriem seko minētās 30 kalendārās dienas.
3. Kompetentās iestādes, veicot 1. un 2. punktā minētos aprēķinus, ņem vērā darījumus, kas izpildīti visās vietās Savienībā, ar obligāciju, strukturētā finansējuma produktu, emisijas kvotu vai attiecīgo atvasināto instrumentu klasēm. Aprēķinus veic tās finanšu instrumentu kategorijas līmenī, kurai piemēro 13. pantā paredzēto likviditātes pārbaudi.
4. Pirms kompetentās iestādes izlemj apturēt pārredzamības pienākumus, tās nodrošina, ka būtiska likviditātes samazināšanās visās tirdzniecības vietās nav sekas, ko ir izraisījusi finanšu instrumentu attiecīgās klases sezonālā ietekme uz likviditāti.

17. pants

Noteikumi, kas attiecas uz obligāciju likviditātes novērtēšanu un konkrētam instrumentam raksturīga pirmstirdzniecības apjoma robežvērtības noteikšanu, balstoties uz tirdzniecības procentīlēm

1. Lai noteiktu obligācijas, kurām nav likvida tirgus, 6. panta nolūkos un saskaņā ar 13. panta 1. punkta b) apakšpunktā precizēto metodi, pieeju likviditātes kritērijiem, kas ietver “dienas vidējo darījumu skaitu”, izmanto, piemērojot “dienas vidējo darījumu skaitu”, kas atbilst S1 posmam (15 dienas darījumi).
2. Attiecībā uz uzņēmuma obligācijām un segtajām obligācijām, kuras atļauts tirgot vai kuras tiek pirmoreiz tirgotas tirdzniecības vietā, uzskata, ka tām ir likvids tirgus, līdz tiek piemēroti pirmās ceturkšņa likviditātes noteikšanas rezultāti, kā izklāstīts 13. panta 18. punktā, ja:
 - a) emisijas apmērs pārsniedz EUR 1 000 000 000 S1 un S2 posmos, kā noteikts saskaņā ar 6. punktu;
 - b) emisijas apmērs pārsniedz EUR 500 000 000 S3 un S4 posmos, kā noteikts saskaņā ar 6. punktu.
3. Lai noteiktu konkrētam finanšu instrumentam raksturīgu apjomu 5. punkta nolūkā un saskaņā ar 13. panta 2. punkta b) apakšpunktā precizēto metodi, piemērojamo pieeju tirdzniecības procentīlei izmanto, piemērojot to tirdzniecības procentīli, kas atbilst S1 posmam (30. procentīle).
4. EVTI līdz 30. jūlijam gadā, kas seko Regulas (ES) Nr. 600/2014 piemērošanas dienai, un pēc tam līdz katra gada 30. jūlijam iesniedz Komisijai novērtējumu par robežvērtību darbību attiecībā uz likviditātes kritēriju “dienas vidējais darījumu skaits” obligācijām, kā arī tirdzniecības procentīlēm, kuras nosaka apjomu, kas raksturīgs finanšu instrumentiem, uz kuriem attiecas 8. punkts. Pienākums iesniegt novērtējumu par robežvērtību darbību attiecībā uz likviditātes kritēriju obligācijām beidzas tad, kad ir sasniegts 6. punktā minētās kārtības S4 posms. Pienākums iesniegt novērtējumu par tirdzniecības procentīlēm beidzas tad, kad ir sasniegts 8. punktā minētās kārtības S4 posms.

5. Šā panta 4. punktā minētajā novērtējumā ņem vērā:
- a) tirdzniecības apjomu tendences attiecībā uz instrumentiem, kas nav kapitāla vērtspapīru instrumenti, uz kuriem attiecas pirmstirdzniecības pārredzamības pienākumi saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 8. un 9. pantu;
 - b) ietekmi uz likviditātes nodrošinātājiem, ko rada procentīļu robežvērtības, ko izmanto, lai noteiktu konkrētam finanšu instrumentam raksturīgu apjomu; un
 - c) pārējos attiecīgos faktoros.
6. EVTI, ņemot vērā novērtējumu, kas veikts saskaņā ar 4. un 5. punktu, iesniedz Komisijai regulatīvo tehnisko standartu grozīto redakciju, pielāgojot robežvērtību likviditātes kritērijam “dienas vidējais darījumu skaits” obligācijām saskaņā ar šādu kārtību:
- a) S2 (10 dienas darījumi) līdz 30. jūlijam gadā pēc Regulas (ES) Nr. 600/2014 piemērošanas dienas;
 - b) S3 (7 dienas darījumi) līdz 30. jūlijam turpmākajā gadā; un
 - c) S4 (2 dienas darījumi) līdz 30. jūlijam turpmākajā gadā.
7. Ja EVTI neiesniedz grozītu regulatīvo tehnisko standartu, pielāgojot robežvērtību nākamajam posmam saskaņā ar 6. punktā minēto kārtību, EVTI novērtējumā, kas veikts saskaņā ar 4. un 5. punktu, sniedz paskaidrojumu, kāpēc nav nodrošināta attiecīgās robežvērtības pielāgošana nākamajam saistītajam posmam. Šajā gadījumā pāreja uz nākamo posmu tiks atlikta par vienu gadu.
8. EVTI, ņemot vērā novērtējumu, kas veikts saskaņā ar 4. un 5. punktu, iesniedz Komisijai regulatīvo tehnisko standartu grozīto redakciju, pielāgojot robežvērtību tirdzniecības procentīlēm saskaņā ar šādu kārtību:
- a) S2 (40. procentīle) līdz 30. jūlijam gadā pēc Regulas (ES) Nr. 600/2014 piemērošanas dienas;
 - b) S3 (50. procentīle) līdz 30. jūlijam turpmākajā gadā; un
 - c) S4 (60. procentīle) līdz 30. jūlijam turpmākajā gadā.
9. Ja EVTI neiesniedz grozītu regulatīvo tehnisko standartu, pielāgojot robežvērtību nākamajam posmam saskaņā ar 8. punktā minēto kārtību, EVTI novērtējumā, kas veikts saskaņā ar 4. un 5. punktu, sniedz paskaidrojumu, kāpēc nav nodrošināta attiecīgās robežvērtības pielāgošana nākamajam saistītajam posmam. Šajā gadījumā pāreja uz nākamo posmu tiks atlikta par vienu gadu.

18. pants

Pārejas noteikumi

1. Kompetentās iestādes ne vēlāk kā sešus mēnešus pirms Regulas (ES) Nr. 600/2014 piemērošanas dienas, apkopo nepieciešamos datus, veic aprēķinus un nodrošina 13. panta 5. punktā minētās informācijas publicēšanu.
2. Šā panta 1. punktā:
 - a) aprēķinu pamatā ir sešu mēnešu atsaucē laikposms, kas sākas 18 mēnešus pirms Regulas (ES) Nr. 600/2014 piemērošanas dienas;
 - b) aprēķinu rezultātus, kas ietverti pirmajā publicēšanas kārtā, izmanto, līdz sāk piemērot pirmos regulāros aprēķinus, kā izklāstīts 13. panta 17. punktā.
3. Atkāpjoties no 1. punkta, attiecībā uz visām obligācijām, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes, kompetentās iestādes dara visu iespējamo, lai nodrošinātu pārredzamības aprēķinu rezultātu publicēšanu, kā precizēts 13. panta 1. punkta b) apakšpunkta i) punktā, ne vēlāk kā tā mēneša pirmajā dienā, pēc kura seko Regulas (ES) Nr. 600/2014 piemērošanas diena, pamatojoties uz trīs mēnešu atsaucē laikposmu, kas sākas tā piektā mēneša pirmajā dienā, pēc kura seko Regulas (ES) Nr. 600/2014 piemērošanas diena.

4. Kompetentās iestādes, tirgus uzturētāji un ieguldījumu brokeru sabiedrības, tostarp ieguldījumu brokeru sabiedrības, kas uztur konkrētu tirdzniecības vietu, izmanto informāciju, kas publicēta saskaņā ar 3. punktu, līdz tiek piemēroti pirmo regulāro aprēķinu rezultāti, kā izklāstīts 13. panta 18. punktā.

5. Attiecībā uz obligācijām, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes, kuras atļauts tirgot vai kuras tiek pirmoreiz tirgotas tirdzniecības vietā, trīs mēnešu laikposmā, pēc kura seko Regulas (ES) Nr. 600/2014 piemērošanas diena, uzskata, ka tām nav likvīda tirgus, kā precizēts III pielikuma 2.2. tabulā, līdz tiek piemēroti pirmo regulāro aprēķinu rezultāti, kā izklāstīts 13. panta 18. punktā.

19. pants

Stāšanās spēkā un piemērošana

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

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

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

Briselē, 2016. gada 14. jūlijā

Komisijas vārdā –
priekšsēdētājs
Jean-Claude JUNKER

I PIELIKUMS

Sistēmas veida apraksts un ar to saistītā informācija, kas jā dara publiski pieejama saskaņā ar 2. pantu**Informācija, kas jā dara publiski pieejama saskaņā ar 2. pantu**

Sistēmas veids	Sistēmas apraksts	Informācija, kas jā dara publiski pieejama
Izsoles rīkojumu reģistra nepārtrauktās tirdzniecības sistēma	Sistēma, kas nepārtraukti ar rīkojumu reģistra un tirdzniecības algoritma palīdzību automātiski savieto pārdošanas rīkojumus ar pirkšanas rīkojumiem, pamatojoties uz labāko pieejamo cenu.	Attiecībā uz katru finanšu instrumentu – rīkojumu kopējais skaits un to apjoms katrā cenu līmenī par vismaz pieciem labākajiem pirkšanas un pārdošanas cenu līmeņiem.
Cenu piedāvājuma virzīta tirdzniecības sistēma	Sistēma, kurā darījumi tiek slēgti, pamatojoties tikai uz stabiliem cenu piedāvājumiem, ko pastāvīgi dara pieejamus dalībniekiem, un saskaņā ar kuriem tirgus uzturētājiem cenu piedāvājumi jā uztur tādā apjomā, kas līdzsvaro locekļu un dalībnieku vajadzības veikt darījumus komerciālos apjomos un ar risku, ko uzņemas attiecīgais tirgus uzturētājs.	Attiecībā uz katru finanšu instrumentu – katra tirgus uzturētāja instrumenta vislabākais pirkšanas un pārdošanas cenas piedāvājums kopā ar apjomu, kas piesaistīts šādām cenām. Publicētie cenu piedāvājumi ir juridisko saistību piedāvājumi pirkt un pārdot finanšu instrumentus un norāda finanšu instrumentu cenu un apjomu, kādā reģistrēti tirgus uzturētāji ir gatavi pirkt vai pārdot. Tomēr ārkārtas tirgus apstākļos uz ierobežotu laika posmu pieļaujamas indikatīvas cenas vai vienas pusē (tikai pirkšanas vai pārdošanas) cenas.
Periodisko izsoļu tirdzniecības sistēma	Sistēma, kas uzdevumus savieto automātiski, pamatojoties uz periodiskām izsolēm un tirdzniecības algoritmu	Attiecībā uz katru finanšu instrumentu – cena, kas izsoļu tirdzniecības sistēmā vislabāk atbilstu tās tirdzniecības algoritmam, un apjoms, ko, iespējams, varētu izpildīt minētās sistēmas dalībnieki par minēto cenu.
Cenu piedāvājumu pieprasīšanas tirdzniecības sistēma	Tirdzniecības sistēma, kurā cenas piedāvājumu vai cenu piedāvājumus sniedz pēc viena vai vairāku locekļu vai dalībnieku pieprasījuma. Cenas piedāvājumu var izpildīt vienīgi pieprasītājs loceklis vai tirgus dalībnieks. Pieprasītājs loceklis vai dalībnieks var noslēgt darījumu, pieņemot tam pēc pieprasījuma sniegto cenas piedāvājumu vai cenu piedāvājumus.	Jebkura locekļa vai dalībnieka cenu piedāvājumi un saistītie apjomi, kuri, ja tiek pieņemti, veidotu darījumu saskaņā ar attiecīgās sistēmas noteikumiem. Visus pēc pieprasījuma iesniegtos cenu piedāvājumus var publicēt vienlaikus, bet ne vēlāk kā no brīža, kad tie kļūst izpildāmi.
Balss tirdzniecības sistēma	Tirdzniecības sistēma, kurā darījumi starp biedriem tiek organizēti, izmantojot mutiskas sarunas.	Pirkšanas un pārdošanas piedāvājumi un jebkura biedra vai dalībnieka pievienotie apjomi, kuru pieņemšanas gadījumā tiks veikts darījums saskaņā ar sistēmas noteikumiem.
Tirdzniecības sistēma, kas nav iekļauta pirmajās 5 rindās	Hibrīdā sistēma, uz kuru attiecināmas divas vai vairākas no pirmajām piecām rindām, vai sistēma, kur cenu noteikšanas process atšķiras no tā procesa, ko piemēro pirmajās piecās rindās iekļauto sistēmu veidiem.	Pienācīga informācija attiecībā uz rīkojumu vai cenu piedāvājumu un tirdzniecības interešu līmeni; konkrētāk, ja cenu atklāšanas mehānisms to pieļauj, pieci labākie pirkšanas un pārdošanas cenu līmeņi un/vai katra tirgus uzturētāja divpusēji (pirkšanas un pārdošanas) cenu piedāvājumi ar konkrēto instrumentu.

II PIELIKUMS

Sīkāka informācija par darījumiem, kas jā dara publiski pieejama

1. tabula

2. tabulas simbolu tabula

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

2. tabula

Sīkās informācijas saraksts pēctirdzniecības pārredzamības nolūkā

Sīkāka informācija	Finanšu instrumenti	Apraksts/sīkāka informācija, kas jāpublicē	Izpildes/publicēšanas veids	Formāts, kas jāaizpilda, kā noteikts 1. tabulā
Tirdzniecības datums un laiks	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Datums un laiks, kad darījums tika veikts.	Regulēts tirgus (RT), daudzpusēja tirdzniecības sistēma (DTS) un organizēta tirdzniecības sistēma (OTS)	{DATE_TIME_FORMAT}

Sīkāka informācija	Finanšu instrumenti	Apraksts/sīkāka informācija, kas jāpublicē	Izpildes/publicēšanas veids	Formāts, kas jāaizpilda, kā noteikts 1. tabulā
		Attiecībā uz darījumiem, kas izpildīti tirdzniecības vietā, – granularitātes līmenis ir saskaņā ar prasībām Komisijas Deleģētās regulas (ES) 2017/574 ⁽¹⁾ 3. pantā. Attiecībā uz darījumiem, kas nav izpildīti tirdzniecības vietā, – datums un laiks, kad puses vienojas par šādām jomām: daudzums, cena, valūtas (31., 34. un 40. laukā, kā noteikts Deleģētās regulas (ES) 2017/590 I pielikuma 2. tabulā, un attiecīgā gadījumā instrumenta identifikācijas kods, instrumenta klasifikācija un pamatā esošā instrumenta kods. Attiecībā uz darījumiem, kas nav izpildīti tirdzniecības vietā, – paziņotais laiks ir granulārs vismaz līdz tuvākajai sekunde. Ja darījuma pamatā ir rīkojums, ko trešajai pusei nodevusi izpildošā sabiedrība klienta vārdā, ja nebija ievēroti nodošanas nosacījumi, kas izklāstīti Deleģētās regulas (ES) 2017/590 5. pantā, šis ir darījuma datums un laiks, nevis rīkojuma nodošanas laiks.	Apstiprināta publicēšanas struktūra (APS) Konsolidētu datu lentes nodrošinātājs (KDLN)	
Instrumenta identifikācijas koda veids	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Koda veids, ko izmanto finanšu instrumenta identificēšanai	RT, DTS, OTS APS KDLN	“ISIN” = ISIN-kods, ja ISIN ir pieejams “OTHR” = cits identifikators
Instrumenta identifikācijas kods	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Kods, ko izmanto finanšu instrumenta identificēšanai	RT, DTS, OTS APS KDLN	{ISIN} Ja instrumenta identifikācijas kods nav ISIN, atvasināto instrumentu identificējošā identifikatora pamatā ir 3.–5., 7., 8. un 12.–42. lauks, kā noteikts IV pielikumā, un 13. un 24.–48. lauks, kā noteikts Deleģētās regulas (ES) 2017/585 pielikumā, un III pielikumā izklāstītā atvasināto instrumentu grupa.
Cena	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Darījuma tirdzniecības cena, izņemot (ja piemērojams) komisijas maksu un uzkrātos procentus.	RT, DTS, OTS APS KDLN	{DECIMAL-18/13}, ja cena ir izteikta kā mone-tāra vērtība

Sīkāka informācija	Finanšu instrumenti	Apraksts/sīkāka informācija, kas jāpublicē	Izpildes/publicēšanas veids	Formāts, kas jāaizpilda, kā noteikts 1. tabulā
		Iespējas līgumu gadījumā tā ir atvasinātā instrumenta līguma prēmija par katru pamatā esošo instrumentu vai indeksa punktu. Cenas starpības derību gadījumā tā ir pamatā esošā instrumenta atsaucēs cena. Attiecībā uz kreditriska mijmaiņas darījumiem (CDS) tas ir kupons bāzes punktos. Ja cena ir uzrādīta naudas izteiksmē, to norāda lielāko valūtu vienībās. Ja cena pašlaik nav pieejama, bet vēl tiks noteikta, vērtībai vajadzētu būt "PNDG". Ja cena nav piemērojama, lauku neaizpilda. Šajā laukā ziņotā informācija saskan ar vērtību, kas norādīta laukā "Daudzums".		{DECIMAL-11/10}, ja cena ir izteikta procentuālā izteiksme vai kā ienesīgums "PNDG", ja cena nav pieejama {DECIMAL-18/17}, ja cena ir izteikta bāzespunktos
Izpildes vieta	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Darījuma izpildes vietas identifikācija. Izmanto ISO 10383 segmenta tirgus identifikācijas kodu (MIC) darījumiem, kurus izpilda tirdzniecības vietā. Ja segmenta MIC nepastāv, izmanto darbības MIC. Izmanto MIC kodu "XOFF" attiecībā uz finanšu instrumentiem, kurus atļauts tirgot vai kurus tirgo tirdzniecības vietā, ja darījums ar attiecīgo finanšu instrumentu nav izpildīts tirdzniecības vietā vai sistemātiskā internālizētājā, vai organizētā tirdzniecības platformā ārpus Savienības. Izmanto SINT attiecībā uz finanšu instrumentu, kurš ir iesniegts tirgošanai vai kuru tirgo tirdzniecības vietā, ja darījums ar attiecīgo finanšu instrumentu tiek izpildīts sistemātiskā internālizētājā.	RT, DTS, OTS APS KDLN	{MIC} – tirdzniecības vietas "SINT" – sistemātisks internālizētājs
Cenas apzīmējums	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Norāde par to, vai cena ir izteikta monetārā vērtībā, procentos vai peļņā	RT, DTS, OTS APS KDLN	"MONE" – monetāra vērtība "PERC" – procenti "YIEL" – ienesīgums "BAPO" – bāzes punkti
Cenas valūta	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Valūta, kurā cena ir izteikta (piemēro, ja cena ir izteikta monetārā vērtībā)	RT, DTS, OTS APS KDLN	{CURRENCYCODE_3}

Sīkāka informācija	Finanšu instrumenti	Apraksts/sīkāka informācija, kas jāpublicē	Izpildes/publicēšanas veids	Formāts, kas jāaizpilda, kā noteikts 1. tabulā
Daudzuma pie- raksts mērvienībā	Attiecībā uz preču atvasinātajiem instrumentiem – emisiju kvotu atvasinātie instrumenti un emisiju kvotas, izņemot gadījumos, kas minēti šīs regulas 11. panta 1. punkta a) un b) apakšpunktā.	Norāde par mērvienībām, kādās izsaka daudzumu mērvienībās	RT, DTS, OTS APS KDLN	“TOCD” – Oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas vai {ALPHANUM-25} citi gadījumi
Daudzums mērvienībās	Attiecībā uz preču atvasinātajiem instrumentiem – emisiju kvotu atvasinātie instrumenti un emisiju kvotas, izņemot gadījumos, kas minēti šīs regulas 11. panta 1. punkta a) un b) apakšpunktā.	Līdzvērtīgais tirgots preču vai emisiju kvotu daudzums, kas izteikts mērvienībās	RT, DTS, OTS APS KDLN	{DECIMAL-18/17}
Daudzums	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem, izņemot gadījumos, kas minēti šīs regulas 11. panta 1. punkta a) un b) apakšpunktā.	Attiecīgā finanšu instrumenta vienību skaits vai atvasināto instrumentu līgumu skaits darījumā.	RT, DTS, OTS APS KDLN	{DECIMAL-18/17}
Nosacītā summa	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem, izņemot gadījumos, kas minēti šīs regulas 11. panta 1. punkta a) un b) apakšpunktā.	Nominālsomme vai nosacītā summa Attiecībā uz cenas starpības derībām nosacītā summa ir monetārā vērtība, par kuru noslēgtas derības uz katru pamatā esošā finanšu instrumenta punkta kustību. Attiecībā uz kredītriska mijmaiņas līgumiem tā ir nosacītā summa, par kuru iegādāta vai pārdota aizsardzība. Šajā laukā ziņotā informācija saskan ar vērtību, kas norādīta laukā “Cena”.	RT, DTS, OTS APS KDLN	{DECIMAL-18/5}
Nosacītā valūta	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem, izņemot gadījumos, kas minēti šīs regulas 11. panta 1. punkta a) un b) apakšpunktā.	Valūta, kurā denominēta nosacītā summa	RT, DTS, OTS APS KDLN	{CURRENCYCODE_3}

Sīkāka informācija	Finanšu instrumenti	Apraksts/sīkāka informācija, kas jāpublicē	Izpildes/publicēšanas veids	Formāts, kas jāaizpilda, kā noteikts 1. tabulā
Rezultāta veids	Tikai attiecībā uz emisiju kvotām un emisiju kvotu atvasinātajiem instrumentiem	Šo lauku piemēro tikai attiecībā uz emisiju kvotām un emisiju kvotu atvasinātajiem instrumentiem.	RT, DTS, OTS APS KDLN	“EUAE” – emisijas kvota (EUA) “CERE” – sertificētas emisijas samazināšanas vienība (CER) “ERUE” – emisijas samazināšanas vienība (ERU) “EUAA” – aviācijas nozares kvota (EUAA) “OTHR” – citi (tikai attiecībā uz atvasinātajiem instrumentiem)
Publicēšanas datums un laiks	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Datums un laiks, kad darījumu publicēja tirdzniecības vieta vai apstiprināta publicēšanas struktūra. Attiecībā uz darījumiem, kas izpildīti tirdzniecības vietā, – līmenis ir saskaņā ar prasībām Deleģētās regulas (ES) 2017/574 2. pantā. Attiecībā uz darījumiem, kas nav izpildīti tirdzniecības vietā, – paziņotais laiks ir granulārs vismaz līdz tuvākajai sekundei.	RT, DTS, OTS APS KDLN	{DATE_TIME_FORMAT}
Publicēšanas vieta	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Kods, ko izmanto, lai identificētu tirdzniecības vietu un APS, kas publicē darījumu.	KDLN	Tirdzniecības vieta {MIC} APS {MIC}, ja tas ir pieejams. Citos gadījumos – 4 burtu kods, kas EVTI tīmekļa vietnē publicēts sarakstā ar datu ziņošanas pakalpojumu sniedzējiem.
Darījuma identifikācijas kods	Attiecībā uz visiem finanšu instrumentiem	Burtciparu kods, ko piešķirusi tirdzniecības vieta (ievērojot 12. pantu Komisijas Deleģētajā Regulā (ES) 2017/580 (?) un APS, un ko izmanto visās turpmākās atsaucēs uz šo konkrēto darījumu. Darījuma identifikācijas kods ir unikāls, konsekvents un pastāvīgs katram ISO10383 MIC segmentam un katrai tirdzniecības dienai. Ja tirdzniecības vieta neizmanto MIC segmentu, darījuma identifikācijas kods ir unikāls, konsekvents un pastāvīgs katram operatīvajam MIC katrai tirdzniecības dienai. Ja APS neizmanto MIC, tam vajadzētu būt unikālam, konsekventam un pastāvīgam katram 4 burtu kodam, ko izmanto, lai identificētu APS katrā tirdzniecības dienā. Darījuma identifikācijas koda komponentes nedrīkst izpaust ziņas par tā darījuma partneru identitāti, kura kods tiek saglabāts.	RT, DTS, OTS APS KDLN	{ALPHANUMERICAL-52}

Sīkāka informācija	Finanšu instrumenti	Apraksts/sīkāka informācija, kas jāpublicē	Izpildes/publicēšanas veids	Formāts, kas jāaizpilda, kā noteikts 1. tabulā
Darījumi, kuriem jāveic tīrvērtē	Attiecībā uz atvasinātajiem instrumentiem	Kods, kas identificē, vai darījumam veikta tīrvērtē.	RT, DTS, OTS APS KDLN	“jā” – darījumam jāveic tīrvērtē “nē” – darījumam nav jāveic tīrvērtē

- (¹) Komisijas 2016. gada 7. jūnija Deleģētā regula (ES) 2017/574, ar ko papildina Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvu 2014/59/ES attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par uzņēmumu pulksteņu precizitātes līmeni (skatīt šā *Oficiālā Vēstneša* 148. lappusi).
- (²) Komisijas 2016. gada 24. jūnija Deleģētā Regula (ES) 2017/580, ar ko Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 600/2014 papildina attiecībā uz regulatīvajiem tehniskajiem standartiem par attiecīgu datu, kuri saistīti ar finanšu instrumentu rīkojumiem, saglabāšanu (skatīt šā *Oficiālā Vēstneša* 193. lappusi).

3. tabula

Karodziņu saraksts pēctirdzniecības pārredzamības nolūkā

	Karodziņš	Karodziņa nosaukums	Izpildes/publicēšanas veids	Apraksts
	“BENC”	Karodziņš, ar ko apzīmē etalona darījumu	RT, DTS, OTS APS KDLN	Visu veidu apjomsvērtās vidējās cenas darījumi un visi citi darījumi, kuros cena aprēķināta vairākos laika brīžos saskaņā ar konkrēto etalonu.
	“ACTX”	Karodziņš, ar ko apzīmē pirkšanas un pārdošanas rīkojumu izpildi vienā darījumā	APS KDLN	Darījumi, kuros ieguldījumu brokeru sabiedrība ir apkopojusi klientu rīkojumus, pirkšanu un pārdošanu veicot kā vienu darījumu un kuri ietver to pašu apjomu un cenu.
	“NPFT”	Cenu neveidojoša darījuma karodziņš	RT, DTS, OTS KDLN	Visu veidu darījumi, kas uzskaitīti šīs regulas 12. pantā un kas neietekmē cenu veidošanu.
	“LRGS”	Karodziņš, ar ko apzīmē pēctirdzniecības darījumu, kas ir liels pēc apjoma	RT, DTS, OTS APS KDLN	Darījumi, kas izpildīti saskaņā ar pēctirdzniecības liela apjoma atlikšanu.
	“ILQD”	Karodziņš, ar ko apzīmē darījumu ar nelikvīdu instrumentu	RT, DTS, OTS APS KDLN	Darījumi, kas izpildīti saskaņā ar to instrumentu atlikšanu, kuriem nav likvida tirgus.
	“SIZE”	Karodziņš, ar ko apzīmē darījumu, kas pārsniedz standarta tirgus apjomu SSTI	RT, DTS, OTS APS KDLN	Darījumi, kas izpildīti saskaņā ar pēctirdzniecības instrumentam raksturīga apjoma atlikšanu.
	“TPAC”	Karodziņš, ar ko apzīmē paketes darījumu	RT, DTS, OTS APS KDLN	Paketes darījumi, kas nav nomaiņa ar fiziķiem līdzekļiem, kā noteikts 1. pantā.

	Karodziņš	Karodziņa nosaukums	Izpildes/publicēšanas veids	Apraksts
	"XFPH"	Nomainas ar fiziskiem līdzekļiem darījuma karodziņš	RT, DTS, OTS APS KDLN	Nomaina ar fiziskiem līdzekļiem, kā noteikts 1. pantā
	"CANC"	Atcelšanas karodziņš	RT, DTS, OTS APS KDLN	Ja ir atcelts iepriekš publicēts darījums.
	"AMND"	Grozījumu karodziņš	RT, DTS, OTS APS KDLN	Ja ir grozīts iepriekš publicēts darījums.

PAPILDU ATLIKŠANAS KARODZIŅI

11. panta 1. punkta a) apakšpunkta i) punkts.	"LMTF"	Ierobežota apjoma sīkākas informācijas karodziņš	RT, DTS, OTS APS KDLN	Pirmais ziņojums ar ierobežota apjoma sīkākas informācijas publicēšanu saskaņā ar 11. panta 1. punkta a) apakšpunkta i) punktu.
	"FULF"	Pilna apjoma sīkākas informācijas karodziņš		Darījums, par kuru saskaņā ar 11. panta 1. punkta a) apakšpunkta i) punktu iepriekš tika publicēta ierobežota apjoma sīkāka informācija.
11. panta 1. punkta a) apakšpunkta ii) punkts.	"DATF"	Dienas kopējo darījumu karodziņš	RT, DTS, OTS APS KDLN	Dienas kopējo darījumu publicēšana saskaņā ar 11. panta 1. punkta a) apakšpunkta ii) punktu.
	"FULA"	Pilna apjoma sīkākas informācijas karodziņš	RT, DTS, OTS APS KDLN	Atsevišķi darījumi, par kuriem saskaņā ar 11. panta 1. punkta a) apakšpunkta ii) punktu iepriekš tika publicēta kopēja sīkāka informācija.
11. panta 1. punkta b) apakšpunkts	"VOLO"	Apjoma nepublicēšanas karodziņš	RT, DTS, OTS APS KDLN	Darījums, par kuru saskaņā ar 11. panta 1. punkta b) apakšpunktu ir publicēta ierobežota apjoma sīkāka informācija.
	"FULV"	Pilna apjoma sīkākas informācijas karodziņš	RT, DTS, OTS APS KDLN	Darījums, par kuru saskaņā ar 11. panta 1. punkta b) apakšpunktu iepriekš tika publicēta ierobežota apjoma sīkāka informācija.
11. panta 1. punkta c) apakšpunkts	"FWAF"	Četrus nedēļu apkopojuma karodziņš	RT, DTS, OTS APS KDLN	Kopējo darījumu publicēšana saskaņā ar 11. panta 1. punkta c) apakšpunktu.
	"FULJ"	Pilna apjoma sīkākas informācijas karodziņš	RT, DTS, OTS APS KDLN	Atsevišķi darījumi, kas iepriekš guvuši labumu no apkopojuma publicēšanas saskaņā ar 11. panta 1. punkta c) apakšpunktu.

	Karodziņš	Karodziņa nosaukums	Izpildes/publīcēšanas veids	Apraksts
11. panta 1. punkta d) apakšpunkts	"IDAF"	Nenoteikta apkopojuma karodziņš	RT, DTS, OTS APS KDLN	Darījumi, par kuriem ir atļauts saskaņā ar 11. panta 1. punkta d) apakšpunktu publicēt informāciju par vairākiem darījumiem apkopotā veidā uz nenoteiktu laiku.
Secīgi izmanto 11. panta 1. punkta b) apakšpunktu un 11. panta 2. punkta c) apakšpunktu attiecībā uz valsts parāda instrumentiem	"VOLW"	Apjoma nepublicēšanas karodziņš	RT, DTS, OTS APS KDLN	Darījums, par kuru saskaņā ar 11. panta 1. punkta b) apakšpunktu publicē ierobežotu sīkāku informāciju un par kuru tiks secīgi atļauts saskaņā ar 11. panta 2. punkta c) apakšpunktu publicēt informāciju par vairākiem darījumiem apkopotā veidā uz nenoteiktu laiku.
	"COAF"	Secīga apkopojuma karodziņš (pēc apjoma nepublicēšanas attiecībā uz valsts parāda instrumentiem)	RT, DTS, OTS APS KDLN	Darījumi, par kuriem saskaņā ar 11. panta 1. punkta b) apakšpunktu iepriekš tika publicēta ierobežota sīkāka informācija un par kuru tika secīgi atļauts saskaņā ar 11. panta 2. punkta c) apakšpunktu publicēt informāciju par vairākiem darījumiem apkopotā veidā uz nenoteiktu laiku.

4. tabula

Apjoma mērs

Instrumenta veids	Apjoms
Visas obligācijas, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes, un strukturētus finanšu produktus	Tirgato parāda instrumentu kopējā nominālā vērtība
Biržā tirgotu preču un biržā tirgotu parādzīmju obligāciju veidi	Tirgoto vienību skaits ⁽¹⁾
Vērtspapīroti atvasinātie instrumenti	Tirgoto vienību skaits ⁽¹⁾
Procentu likmju atvasinātie instrumenti	Tirgoto līgumu nosacītā summa
Ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti	Tirgoto līgumu nosacītā summa
Kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti	Tirgoto līgumu nosacītā summa
Atvasinātie preču instrumenti	Tirgoto līgumu nosacītā summa
Kredītu atvasinātie instrumenti	Tirgoto līgumu nosacītā summa
Līgums par cenu starpībām	Tirgoto līgumu nosacītā summa
C10 atvasinātie instrumenti	Tirgoto līgumu nosacītā summa
Emisiju kvotu atvasinātie instrumenti	Oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas
Emisiju kvotas	Oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas

⁽¹⁾ Cena par vienību.

III PIELIKUMS

Likviditātes novērtējums, LIS un SSTI robežvērtības attiecībā uz finanšu instrumentiem, kas nav kapitāla vērtspapīru finanšu instrumenti**1. Šajā pielikumā lieto šādas norādes**

1. Atsauce uz “aktīvu klasi” ir atsauce uz šādam finanšu instrumentu klasēm: obligācijas, strukturēti finanšu produkti, vērtspapīroti atvasinātie instrumenti, procentu likmju atvasinātie instrumenti, kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti, preču atvasinātie instrumenti, ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti, kredītu atvasinātie instrumenti, C10 atvasinātie instrumenti, līgumi par cenu starpībām (CFD), emisiju kvotas un emisiju kvotu atvasinātie instrumenti.
2. Atsauce uz “aktīvu apakšklasi” ir atsauce uz aktīvu klasi, kas iedalīta granularākā līmenī, pamatojoties uz līguma veidu un/vai pamatā esošā instrumenta veidu.
3. Atsauce uz “apakšklasi” ir atsauce uz aktīvu apakšklasi, kas iedalīta granularākā līmenī, pamatojoties uz sīkākiem kvalitatīvajiem segmentācijas kritērijiem, kā noteikts šā pielikuma 2.1.–13.3. tabulās.
4. “Dienas vidējais apgrozījums (ADT)” ir kopējais konkrēta finanšu instrumenta apgrozījums, ko nosaka saskaņā ar apjoma mēru, kas izklāstīts II pielikuma 4. tabulā, un ko izpilda laikposmā, kas noteikts 13. panta 7. punktā, to dalot ar tirdzniecības dienu skaitu minētajā laikposmā vai attiecīgā gadījumā tajā gada daļā, kurā šo finanšu instrumentu bija atļauts tirgot vai to tirgoja tirdzniecības vietā, un tā tirdzniecība nebija apturēta.
5. “Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA)” ir kopējā konkrēta finanšu instrumenta nosacītā summa, ko nosaka saskaņā ar apjoma mēru, kas izklāstīts II pielikuma 4. tabulā, un ko izpilda laikposmā, kas noteikts 13. panta 18. punktā attiecībā uz visām obligācijām, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes, un 13. panta 7. punktā attiecībā uz visiem pārējiem finanšu instrumentiem, to dalot ar tirdzniecības dienu skaitu minētajā laikposmā vai, attiecīgā gadījumā, tajā gada daļā, kurā šo finanšu instrumentu bija atļauts tirgot vai to tirgoja tirdzniecības vietā, un tā tirdzniecība nebija apturēta.
6. “To dienu procentuālais īpatsvars, kurās aplūkotajā laikposmā notika tirdzniecība” ir dienu skaits laikposmā, kas noteikts 13. panta 18. punktā attiecībā uz visām obligācijām, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes, un 13. panta 7. punktā attiecībā uz strukturētā finansējuma produktiem, par kuriem ir izpildīts vismaz viens darījums attiecībā uz šo finanšu instrumentu, to dalot ar tirdzniecības dienu skaitu minētajā laikposmā vai, attiecīgā gadījumā, tajā gada daļā, kurā šo finanšu instrumentu bija atļauts tirgot vai to tirgoja tirdzniecības vietā, un tā tirdzniecība nebija apturēta.
7. “Dienas vidējais darījumu skaits” ir kopējais darījumu skaits, kas attiecībā uz konkrētu finanšu instrumentu izpildīti laikposmā, kas noteikts 13. panta 18. punktā attiecībā uz visām obligācijām, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes, un 13. panta 7. punktā attiecībā uz visiem pārējiem finanšu instrumentiem, to dalot ar tirdzniecības dienu skaitu šajā laikposmā vai, attiecīgā gadījumā, tajā gada daļā, kurā finanšu instrumentu bija atļauts tirgot vai to tirgoja tirdzniecības vietā, un tā tirdzniecība nebija apturēta.
8. “Regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums” ir līgums par preces vai finanšu instrumenta pirkšanu vai pārdošanu noteiktā datumā nākotnē par cenu, par kuru tika panākta vienošanās, pircējam un pārdevējam noslēdzot šo līgumu. Visiem regulētā tirgū tirgotiem nākotnes līgumiem ir standarta noteikumi, kas nosaka minimālo pirkšanas vai pārdošanas daudzumu un kvalitāti, mazāko summu, par kādu cena var mainīties, piegādes procedūras, termiņu un citas līguma īpašības.
9. “Iespējas līgums” ir līgums, kas īpašniekam dod tiesības, tomēr neuzliek saistības pirkt (*call*) vai pārdot (*put*) konkrētu finanšu instrumentu vai precī par iepriekš noteiktu cenu, iespējas līguma izmantošanas cenu (*strike* vai *exercise price*) vai nu noteiktā datumā, vai līdz noteiktam iespējas līguma izmantošanas datumam (*exercise* vai *maturity date*).
10. “Mijmaiņas līgums” ir līgums, kurā divas puses vienojas kādā konkrētā dienā nākotnē apmainīt naudas plūsmas vienā finanšu instrumentā pret cita finanšu instrumenta naudas plūsmām.
11. “Portfeļa mijmaiņas līgums” ir līgums, saskaņā ar kuru galalietotāji var tirgoties ar vairākiem mijmaiņas līgumiem.

12. "Regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums" ir privāta vienošanās starp divām pusēm par preces vai finanšu instrumenta pirkšanu vai pārdošanu noteiktā datumā nākotnē par cenu, par kuru tika panākta vienošanās, pircējam un pārdevējam noslēdzot šo līgumu.
13. "Mijmaiņas iespējas līgums" ir līgums, kas īpašniekam dod tiesības, tomēr neuzliek saistības noslēgt mijmaiņas līgumu vai nu noteiktā datumā, vai līdz noteiktam iespējas līguma izmantošanas datumam (*exercise* vai *maturity date*).
14. "Regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums par mijmaiņas līgumu" ir regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums, kas īpašniekam dod tiesības, tomēr neuzliek saistības noslēgt mijmaiņas līgumu vai nu noteiktā datumā, vai līdz noteiktam nākotnes datumam.
15. "Regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par mijmaiņas līgumu" ir regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums, kas īpašniekam dod tiesības, tomēr neuzliek saistības noslēgt mijmaiņas līgumu vai nu noteiktā datumā, vai līdz noteiktam nākotnes datumam.

2. Obligācijas

2.1. tabula

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

Aktīvu klase – obligācijas (visi obligāciju veidi, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes)					
Par katru atsevišķu finanšu instrumentu uzskata, ka tam nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tas kumulatīvi neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām					
Dienas vidējā nosacītā summa [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]				To dienu procentuālais īpatsvars, kurās aplūkotajā laikposmā notika tirdzniecība [3. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
EUR 100 000	S1	S2	S3	S4	80 %
	15	10	7	2	

2.2. tabula

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

Aktīvu klase – obligācijas (visi obligāciju veidi, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes)			
Par katru atsevišķu obligāciju uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 13. panta 18. punktu, ja to raksturo obligācijas veida un emitēšanas lieluma konkrēta kombinācija, kā norādīts katrā tabulas rindā			
Obligācijas veids		Emisijas apjoms	
Valsts obligācija	ir obligācija, ko emitējis valsts emitents, kas ir: a) Savienība; b) dalībvalsts, tostarp dalībvalsts valdības departaments, aģentūra vai īpašam nolūkam dibināta sabiedrība; c) publiska struktūra, kas nav minēta a) vai b) apakšpunktā.	mazāka nekā (EUR)	1 000 000 000

Aktīvu klase – obligācijas (visi obligāciju veidi, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes)				
Obligācijas veids		Emisijas apjoms		
Cita valsts obligācija	ir obligācija, ko emitējis jebkurš no šādiem publiskiem emitentiem: a) federālas dalībvalsts gadījumā – minētās federācijas loceklis; b) vairāku dalībvalstu īpašam nolūkam dibināta sabiedrība; c) starptautiska finanšu iestāde, kuru izveidojušas divas vai vairākas dalībvalstis un kuras uzdevums ir nodrošināt finansējumu un sniegt finanšu palīdzību tās locekļiem, kurus piemeklējušas smagas finansiāla rakstura problēmas vai kuriem tādas draud; d) Eiropas Investīciju banka; e) publiska struktūra, kas nav valsts obligācijas emitents, kā norādīts iepriekšējā rindā.	mazāka nekā (EUR)		500 000 000
Konvertējama obligācija	ir instruments, ko veido obligācija vai vērtspapīrots parāda instruments ar iegultu atvasināto instrumentu, piemēram, iespēju iegādāties pamatā esošu kapitāla vērtspapīru instrumentu	mazāka nekā (EUR)		500 000 000
Segtā obligācija	ir obligācija, kas minēta Direktīvas 2009/65/ES 52. panta 4. punkta a) apakšpunktā;	S1 un S2 posma laikā		S3 un S4 posma laikā
		mazāka nekā (EUR)	1 000 000 000	mazāka nekā (EUR) 500 000 000
Uzņēmuma obligācija	ir obligācija, ko izsniegusi <i>Societas Europaea</i> , kas izveidota saskaņā ar Padomes Regulu (EK) Nr. 2157/2001 ⁽¹⁾ , vai Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2009/101/EK ⁽²⁾ 1. pantā uzskaitīts uzņēmuma veids vai tam līdzvērtīgs uzņēmuma veids trešās valstīs	S1 un S2 posma laikā		S3 un S4 posma laikā
		mazāka nekā (EUR)	1 000 000 000	mazāka nekā (EUR) 500 000 000
Obligācijas veids	Lai noteiktu finanšu instrumentus, par kuriem uzskata, ka tiem nav likvīda tirgus saskaņā ar 13. panta 18. punktu, piemēro šādu metodi			
Citas obligācijas	Tiek uzskatīts, ka obligācijām, kas nepieder ne pie viena no iepriekš minēto obligāciju veidiem, nav likvīda tirgus			

⁽¹⁾ Padomes 2001. gada 8. oktobra Regula (EK) Nr. 2157/2001 par Eiropas uzņēmēj sabiedrības (SE) statūtiem (OV L 294, 10.11.2001., 1. lpp.).

⁽²⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2009. gada 16. septembra Direktīva 2009/101/EK par to, kā vienādošanas nolūkā koordinēt nodrošinājumus, ko dalībvalstis prasa no sabiedrībām Līguma 48. panta otrās daļas nozīmē, lai aizsargātu sabiedrību dalībnieku un trešo personu intereses (OV L 258, 1.10.2009., 11. lpp.).

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

Aktīvu klase – obligācijas (visi obligāciju veidi, izņemot biržā tirgotas preces un biržā tirgotas parādzīmes)											
Obligācijas veids	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības katram obligāciju veidam	Procentīles, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katram obligāciju veidam									
		SSTI pirmstirdzniecība				LIS pirmstirdzniecība		SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība		
		Tirdzniecība – procentīle		Minimālā robežvērtība		Tirdzniecība – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Tirdzniecība – procentīle		
Valsts obligācija	darījumi, kas izpildīti ar valsts obligācijām pēc 13. panta 10. punktā norādīto darījumu izslēgšanas	S1	S2	S3	S4	EUR 300 000	70	EUR 300 000	80	90	
		30	40	50	60						
Cita valsts obligācija	darījumi, kas izpildīti ar citām valsts obligācijām pēc 13. panta 10. punktā norādīto darījumu izslēgšanas	S1	S2	S3	S4	EUR 300 000	70	EUR 300 000	80	90	
		30	40	50	60						
Konvertējama obligācija	darījumi, kas izpildīti ar konvertējamām obligācijām pēc 13. panta 10. punktā norādīto darījumu izslēgšanas	S1	S2	S3	S4	EUR 200 000	70	EUR 200 000	80	90	
		30	40	50	60						
Segtā obligācija	darījumi, kas izpildīti ar segtām obligācijām pēc 13. panta 10. punktā norādīto darījumu izslēgšanas	S1	S2	S3	S4	EUR 300 000	70	EUR 300 000	80	90	
		30	40	40	40						
Uzņēmuma obligācija	darījumi, kas izpildīti ar uzņēmuma obligācijām pēc 13. panta 10. punktā norādīto darījumu izslēgšanas	S1	S2	S3	S4	EUR 200 000	70	EUR 200 000	80	90	
		30	40	50	60						
Citas obligācijas	darījumi, kas izpildīti ar citām obligācijām pēc 13. panta 10. punktā norādīto darījumu izslēgšanas	S1	S2	S3	S4	EUR 200 000	70	EUR 200 000	80	90	
		30	40	50	60						

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

Aktīvu klase – obligācijas (biržā tirgotu preču un biržā tirgotu parādzīmju obligāciju veidi)		
Obligācijas veids	Par katru atsevišķu finanšu instrumentu uzskata, ka tam nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tas neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām	
	Dienas vidējais apgrozījums (ADT) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Biržā tirgotas preces (ETC) parāda instruments, kas emitēts emitenta tiešam ieguldījumam preču vai preču atvasināto instrumentu līgumos. <i>ETC</i> cena ir tieši vai netieši saistīti ar pamatā esošā instrumenta darbības rezultātiem. <i>ETC</i> pasīvi seko tās preces vai preces indeksa darbības rezultātiem, uz ko tās attiecas.	EUR 500 000	10
Biržā tirgotas parādzīmes (ETN) parāda instruments, kas emitēts emitenta tiešam ieguldījumam pamatā esošos atvasinātos instrumentos vai pamatā esošo atvasināto instrumentu līgumos. <i>ETN</i> cena ir tieši vai netieši saistīti ar pamatā esošā instrumenta darbības rezultātiem. <i>ETN</i> pasīvi seko tā pamatā esošā instrumenta darbības rezultātiem, uz ko tās attiecas.	EUR 500 000	10

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

Aktīvu klase – obligācijas (biržā tirgotu preču un biržā tirgotu parādzīmju obligāciju veidi)				
Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katram atsevišķam instrumentam, par kuru konstatēts, ka tam ir likvids tirgus				
Obligācijas veids	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
ETC	EUR 1 000 000	EUR 1 000 000	EUR 50 000 000	EUR 50 000 000
ETN	EUR 1 000 000	EUR 1 000 000	EUR 50 000 000	EUR 50 000 000

Aktīvu klase – obligācijas (biržā tirgotu preču un biržā tirgotu parādzīmju obligāciju veidi)				
Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katram atsevišķajam instrumentam, par kuru konstatēts, ka tam nav likvida tirgus				
Obligācijas veids	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
ETC	EUR 900 000	EUR 900 000	EUR 45 000 000	EUR 45 000 000
ETN	EUR 900 000	EUR 900 000	EUR 45 000 000	EUR 45 000 000

3. Strukturētā finansējuma produkti (SFP)

3.1. tabula

SFP – klases, kurām nav likvida tirgus

Aktīvu klase – strukturētā finansējuma produkti (SFP)		
1. tests – SFP aktīvu klases novērtējums		
Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot vērtības, kas saistītas ar kvantitatīvajiem likviditātes kritērijiem, lai novērtētu SFP aktīvu klasi	SFP aktīvu klasi novērtē, piemērojot šādas kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtības	
	Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Darījumi, kas izpildīti visos SFP	EUR 300 000 000	500
2. tests – SFP, kam nav likvida tirgus		

Ja vērtības, kas saistītas ar kvantitatīvajiem likviditātes kritērijiem, abas pārsniedz kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtības, kas noteiktas, lai novērtētu SFP aktīvu klasi, 1. tests ir nokārtots un tiek veikts 2. tests. Par katru atsevišķu finanšu instrumentu uzskata, ka tam nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tas neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām

Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	To dienu procentuālais īpatsvars, kurās aplūkotojā laikposmā notika tirdzniecība [3. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
EUR 100 000	2	80 %

SFP – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības, ja 1. tests nav nokārtots

Aktīvu klase – strukturētā finansējuma produkti (SFP)			
Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības visiem SFP, ja 1. tests nav nokārtots			
SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
EUR 100 000	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 1 000 000

SFP – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības, ja 1. tests ir nokārtots

Aktīvu klase – strukturētā finansējuma produkti (SFP)											
Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības SFP, par kuriem konstatēts, ka tiem ir likvids tirgus, ja 1. tests ir nokārtots										
	SSTI pirmstirdzniecība				LIS pirmstirdzniecība		SSTI pēctirdzniecība		LIS pēctirdzniecība		
	Tirdzniecība – procentīle				Minimālā robežvērtība		Tirdzniecība – procentīle		Minimālā robežvērtība		
Darījumi, kas izpildīti visos SFP, par kuriem konstatēts, ka tiem ir likvids tirgus	S1	S2	S3	S4	EUR 100 000	70	EUR 250 000	80	EUR 500 000	90	EUR 1 000 000
	30	40	50	60							

Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības SFP, par kuriem konstatēts, ka tiem nav likvida tirgus, ja 1. tests ir nokārtots			
SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
EUR 100 000	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 1 000 000

4. Vērtspapīroti atvasinātie instrumenti

4.1. tabula

Vērtspapīroti atvasinātie instrumenti – klases, kurām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – vērtspapīroti atvasinātie instrumenti

ir pārvedami vērtspapīri, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES 4. panta 1. punkta 44) apakšpunkta c) punktā, kas nav strukturētā finansējuma produkti, un tiem būtu jāietver vismaz:

- a) tradicionālas (*plain vanilla*) segtas garantijas ir vērtspapīri, kas turētājam dod tiesības, tomēr neuzliek saistības termiņa beigās vai līdz termiņa beigām pirkt (pārdot) noteiktu pamatā esoša aktīva apjomu par iepriekš noteiktu iespējas līguma izmantošanas cenu vai gadījumā, ja ir noteikta samaksa skaidrā naudā, pozitīvās starpības maksājumu starp pašreizējo tirgus cenu (iespējas līguma izmantošanas cenu) un iespējas līguma izmantošanas cenu (pašreizējo tirgus cenu);
- b) sviras sertifikāts ir sertifikāts, kas seko pamatā esoša aktīva darbības rezultātiem ar sviras efektu;
- c) eksotiskas segtas garantijas ir segtas garantijas, kuru galvenais komponents ir iespējas līgumu kombinācija;
- d) maināma instrumenta tiesības;
- e) ieguldījuma sertifikāts ir sertifikāts, kas seko pamatā esoša aktīva darbības rezultātiem bez sviras efekta.

Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi

tiek uzskatīts, ka visiem vērtspapīrotiem atvasinātiem instrumentiem ir likvīds tirgus

4.2. tabula

Vērtspapīroti atvasinātie instrumenti – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības

Aktīvu klase – vērtspapīroti atvasinātie instrumenti

Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības

SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
EUR 50 000	EUR 60 000	EUR 90 000	EUR 100 000

5. Procentu likmju atvasinātie instrumenti

5.1. tabula

Procentu likmju atvasinātie instrumenti – klases, kurām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti				
jebkurš līgums, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma C iedaļas 4. punktā, kura galīgais pamatā esošais instruments ir procentu likme, obligācija, aizdevums, grozs, portfelis vai indekss, kas ietver procentu likmi, obligāciju, aizdevumu vai jebkuru citu produktu, kas ataino procentu likmes, obligācijas vai aizdevuma darbības rezultātus.				
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs
Obligāciju regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi	obligāciju regulētā tirgū tirgotu nākotnes līgumu/regulētā tirgū netirgotu nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esoša atvasināta instrumenta emitents 2. segmentācijas kritērijs – turpmāk definētas pamatā esošas piegādājamās obligācijas termiņš Īstermiņa: tiek uzskatīts, ka pamatā esoša piegādājama obligācija ar termiņu no 1 līdz 4 gadiem ir īstermiņa obligācija Vidējā termiņa: tiek uzskatīts, ka pamatā esoša piegādājama obligācija ar termiņu no 4 līdz 8 gadiem ir vidēja termiņa obligācija Ilgttermiņa: tiek uzskatīts, ka pamatā esoša piegādājama obligācija ar termiņu no 8 līdz 15 gadiem ir ilgttermiņa obligācija Īpaša ilgttermiņa: tiek uzskatīts, ka pamatā esoša piegādājama obligācija ar termiņu virs 15 gadiem ir īpaša ilgttermiņa obligācija	EUR 5 000 000	10	ikreiz, kad par kādu apakšklasi tiek konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus attiecībā uz laiku, kāds atlicis līdz termiņam, un par to apakšklasi, kuru definē saskaņā ar nākamā laiku, kāds atlicis līdz termiņam, tiek konstatēts, ka tai nav likvīda tirgus, uzskata, ka pirmā iepriekšējā mēneša (<i>back month</i>) līgumam ir likvīds tirgus divas nedēļas līdz esošā mēneša (<i>front month</i>) beigām

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvids tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs
	3. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 2. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 3. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads 4. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi 5. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi ... m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi			
Obligāciju iespējas līgumi	obligācijas iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esoša obligācija vai pamatā esošās obligācijas regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums 2. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks iespējas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 2. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 3. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	EUR 5 000 000	10	

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvids tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs
	4. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi 5. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi ... m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi			
Procentu likmju (IR) regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi un biržā netirgoti procentu likmes nākotnes līgumi (FRA)	procentu likmes regulētā tirgū tirgota nākotnes līguma apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esoša procentu likme 2. segmentācijas kritērijs – pamatā esošas procentu likmes termiņš 3. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 2. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 3. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads 4. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi 5. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi ... m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	EUR 500 000 000	10	ikreiz, kad par kādu apakšklasi tiek konstatēts, ka tai ir likvids tirgus attiecībā uz laiku, kāds atlicis līdz termiņam, un par to apakšklasi, kuru definē saskaņā ar nākamā laiku, kāds atlicis līdz termiņam, tiek konstatēts, ka tai nav likvida tirgus, uzskata, ka pirmā iepriekšējā mēneša (<i>back month</i>) līgumam ir likvids tirgus divas nedēļas līdz esošā mēneša (<i>front month</i>) beigām

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvids tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs
Procentu likmes iespējas līgumi	procentu likmes iespējas līguma apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esoša procentu likme vai pamatā esošas procentu likmes regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums vai <i>FRA</i> 2. segmentācijas kritērijs – pamatā esošas procentu likmes termiņš 3. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks iespējas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 2. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 3. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads 4. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi 5. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi ... m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	EUR 500 000 000	10	

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvids tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs
Mijmaiņas iespējas līgumi	mijmaiņas iespējas līguma apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esoša mijmaiņas līguma veids, kas definēts šādi: fiksēto procentu likmju vienas valūtas mijmaiņas līgums, regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par fiksēto procentu likmju vienas valūtas mijmaiņas līgumu, fiksētās un mainīgās procentu likmes vienas valūtas mijmaiņas līgums un regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par fiksētās un mainīgās procentu likmes vienas valūtas mijmaiņas līgumu, mainīgo procentu likmju vienas valūtas mijmaiņas līgums un regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par mainīgo procentu likmju vienas valūtas mijmaiņas līgumu, inflācijai piesaistīts vienas valūtas mijmaiņas līgums un regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par inflācijai piesaistītu vienas valūtas mijmaiņas līgumu, OIS vienas valūtas mijmaiņas līgums un regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par OIS vienas valūtas mijmaiņas līgumu, fiksēto procentu likmju vairāku valūtu mijmaiņas līgums un regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par fiksēto procentu likmju vairāku valūtu mijmaiņas līgumu, fiksētās un mainīgās procentu likmes vairāku valūtu mijmaiņas līgums un regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par fiksētās un mainīgās procentu likmes vairāku valūtu mijmaiņas līgumu, mainīgo procentu likmju vairāku valūtu mijmaiņas līgums un regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par mainīgo procentu likmju vairāku valūtu mijmaiņas līgumu, inflācijai piesaistīts vairāku valūtu mijmaiņas līgums un regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par inflācijai piesaistītu vairāku valūtu mijmaiņas līgumu, OIS vairāku valūtu mijmaiņas līgums un regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par OIS vairāku valūtu mijmaiņas līgumu 2. segmentācijas kritērijs – nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta iespējas līguma nosacītā summa	EUR 500 000 000	10	

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvids tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs
	3. segmentācijas kritērijs – inflācijas indekss, ja pamatā esošā mijmaiņas līguma veids ir inflācijai piesaistīts vienas valūtas mijmaiņas līgums vai inflācijai piesaistīts vairāku valūtu mijmaiņas līgums 4. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 4. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads 5. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi 6. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi ... m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi			
	5. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks iespējas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 2. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads 3. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi 4. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 5 gadi			

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvids tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs
	5. termiņu grupa: 5 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 10 gadi 6. termiņu grupa: vairāk nekā 10 gadi			
Fiksētās un mainīgās procentu likmes “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fiksētās un mainīgās procentu likmes “vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem” mijmaiņas līgums vai regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par mijmaiņas līgumu, kurā divas puses apmainās ar naudas plūsmām, kas denominētas dažādās valūtās, un kurā vismaz vienu daļu nosaka saskaņā ar mainīgu procentu likmi	fiksētās un mainīgās procentu likmes vairāku valūtu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – nosacīto valūtu pāris ir definēts kā to abu valūtu pāris, kurās ir denominētas mijmaiņas līguma abas daļas 2. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < termiņš ≤ 1 mēnesis 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < termiņš ≤ 3 mēneši 3. termiņu grupa: 3 mēneši < termiņš ≤ 6 mēneši 4. termiņu grupa: 6 mēneši < termiņš ≤ 1 gads 5. termiņu grupa: 1 gads < termiņš ≤ 2 gadi 6. termiņu grupa: 2 gadi < termiņš ≤ 3 gadi ... m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	EUR 50 000 000	10	

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

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

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvids tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs
Uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (OIS) “vai-rākū valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpva-lūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regu-lētā tirgū netirgoti nā-kotnes līgumi par uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas da-rījumu (OIS) “vienas valūtas mijmaiņas līgu-miem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem” mijmaiņas līgums vai re-gulētā tirgū tirgots nākot-nes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par mijmaiņas līgumu, kurā divas puses apmai-nās ar naudas plūsmām, kas denominētas dažādās valūtās, un kurā vismaz vienas daļas naudas plūs-mas nosaka atbilstīgi uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darī-jumu (OIS) likmei	uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (OIS) vairāku valūtu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – nosacīto valūtu pāris ir definēts kā to abu valūtu pāris, kurās ir denominētas mijmaiņas līguma abas daļas 2. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks mijmai-ņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mē-neši 3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mē-neši 4. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads 5. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi 6. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi ... m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	EUR 50 000 000	10	

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvids tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs
Inflācijai piesaistītu “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par inflācijai piesaistītiem “vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem” mijmaiņas līgums vai regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par mijmaiņas līgumu, kurā divas puses apmaiņās ar naudas plūsmām, kas denominētas dažādās valūtās, un kurā vismaz vienas daļas naudas plūsmas nosaka saskaņā ar inflācijas likmi	inflācijai piesaistītu vairāku valūtu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – nosacīto valūtu pāris ir definēts kā to abu valūtu pāris, kurās ir denominētas mijmaiņas līguma abas daļas 2. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 4. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads 5. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi 6. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi ... m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	EUR 50 000 000	10	

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvids tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs
Fiksētās un mainīgās procentu likmes “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fiksētās un mainīgās procentu likmes “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem” mijmaiņas līgums vai regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par mijmaiņas līgumu, kurā divas puses apmaiņās ar naudas plūsmām, kas denominētas vienā un tajā pašā valūtā, un kurā vismaz vienu daļu nosaka saskaņā ar inflācijas likmi	fiksētās un mainīgās procentu likmes vienas valūtas apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – nosacītā valūta, kurā ir denominētas mijmaiņas līguma abas daļas 2. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 4. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads 5. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi 6. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi ... m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	EUR 50 000 000	10	

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

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvids tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs
Fiksēto procentu likmju “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fikstēto procentu likmju “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem” mijmaiņas līgums vai regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par mijmaiņas līgumu, kurā divas puses apmaiņās ar naudas plūsmām, kas denominētas vienā un tajā pašā valūtā, un kurā abu daļu naudas plūsmas nosaka saskaņā ar fikstētām procentu likmēm	fiksēto procentu likmju vienas valūtas apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – nosacītā valūta, kurā ir denominētas mijmaiņas līguma abas daļas 2. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 4. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads 5. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi 6. termiņu grupa : 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi ... m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	EUR 50 000 000	10	

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvids tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs
Uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (OIS) “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (OIS) “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem” mijmaiņas līgums vai regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par mijmaiņas līgumu, kurā divas puses apmaiņās ar naudas plūsmām, kas denominētas vienā un tajā pašā valūtā, un kurā vismaz vienas daļas naudas plūsmas nosaka atbilstīgi uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (OIS) likmei	uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (OIS) vienas valūtas apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – nosacītā valūta, kurā ir denominētas mijmaiņas līguma abas daļas 2. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 4. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads 5. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi 6. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi ... m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	EUR 50 000 000	10	

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvīds tirgus, attiecīgā gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs
Inflācijai piesaistīti “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par inflācijai piesaistītiem “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem” mijmaiņas līgums vai regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par mijmaiņas līgumu, kurā divas puses apmaiņās ar naudas plūsmām, kas denominētas vienā un tajā pašā valūtā, un kurā vismaz vienu daļu nosaka pēc inflācijas likmes	inflācijai piesaistītas vienas valūtas apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – nosacītā valūta, kurā ir denominētas mijmaiņas līguma abas daļas 2. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis 2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 4. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads 5. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi 6. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi ... m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	EUR 50 000 000	10	
Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi			
Citi procentu likmju atvasinātie instrumenti procentu likmes atvasinātais instruments, kas nepieder nevienai no iepriekšminētajām aktīvu apakšklasēm	par visiem pārējiem procentu likmes atvasinātajiem instrumentiem uzskata, ka tiem nav likvīda tirgus			

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

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti														
Aktīvu apakšklase	Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus													
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	SSTI pirmstirdzniecība				LIS pirmstirdzniecība		SSTI pēctirdzniecība			LIS pēctirdzniecība			
		Tirdzniecība – procentīle				Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Apjoms – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Apjoms – procentīle	Minimālā robežvērtība
Obligāciju regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 20 000 000	90	70	EUR 25 000 000
		30	40	50	60									
Obligāciju iespējas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 20 000 000	90	70	EUR 25 000 000
		30	40	50	60									
Procentu likmes (IR) regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi un biržā netirgoti procentu likmes nākotnes līgumi (FRA)	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 5 000 000	70	EUR 10 000 000	80	60	EUR 20 000 000	90	70	EUR 25 000 000
		30	40	50	60									

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti														
Aktīvu apakšklase	Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvids tirgus													
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	SSTI pirmstirdzniecība				LIS pirmstirdzniecība		SSTI pēctirdzniecība			LIS pēctirdzniecība			
		Tirdzniecība – procentīle				Tirdzniecība – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Apjoms – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Apjoms – procentīle	Minimālā robežvērtība	
Procentu likmes iespējas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 5 000 000	70	EUR 10 000 000	80	60	EUR 20 000 000	90	70	EUR 25 000 000
		30	40	50	60									
Mijmaiņas iespējas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									
Fiksētās un mainīgās procentu likmes “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fiksētās un mainīgās procentu likmes “vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem”	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti													
Aktīvu apakšklase	Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvids tirgus												
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	SSTI pirmstirdzniecība				LIS pirmstirdzniecība		SSTI pēctirdzniecība			LIS pēctirdzniecība		
		Tirdzniecība – procentīle				Tirdzniecība – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Apjoms – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Apjoms – procentīle	Minimālā robežvērtība
Mainīgo procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par mainīgo procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem”	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1 30	S2 40	S3 50	S4 60	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80 60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
Fiksēto procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fikseto procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem”	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1 30	S2 40	S3 50	S4 60	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80 60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
Uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (OIS) “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (OIS) “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem”	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1 30	S2 40	S3 50	S4 60	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80 60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti													
Aktīvu apakšklase	Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvids tirgus												
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	SSTI pirmstirdzniecība				LIS pirmstirdzniecība		SSTI pēctirdzniecība			LIS pēctirdzniecība		
		Tirdzniecība – procentīle				Tirdzniecība – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Apjoms – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Apjoms – procentīle	Minimālā robežvērtība
Inflācijai piesaistītu “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par inflācijai piesaistītiem “vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem”	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1 30	S2 40	S3 50	S4 60	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80 60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
Fiksētās un mainīgās procentu likmes “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fiksētās un mainīgās procentu likmes “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem”	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1 30	S2 40	S3 50	S4 60	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80 60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
Mainīgo procentu likmju “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par mainīgo procentu likmju “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem”	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1 30	S2 40	S3 50	S4 60	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80 60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti														
Aktīvu apakšklase	Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvids tirgus													
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	SSTI pirmstirdzniecība				LIS pirmstirdzniecība		SSTI pēctirdzniecība			LIS pēctirdzniecība			
		Tirdzniecība – procentīle				Tirdzniecība – procentīle		Tirdzniecība – procentīle		Tirdzniecība – procentīle		Tirdzniecība – procentīle		
Fiksēto procentu likmju “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fiksēto procentu likmju “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem”	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									
Uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (OIS) “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (OIS) “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem”	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									
Inflācijai piesaistīti “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par inflācijai piesaistītiem “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem”	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									

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

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai nav likvīda tirgus			
	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
Obligāciju regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Obligācijas iespējas līgumi	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Procentu likmju (IR) regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi un biržā netirgoti procentu likmes nākotnes līgumi (FRA)	EUR 5 000 000	EUR 10 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Procentu likmes iespējas līgumi	EUR 5 000 000	EUR 10 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Mijmaiņas iespējas līgumi	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
Fiksētās un mainīgās procentu likmes “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fiksētās un mainīgās procentu likmes “vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem”	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
Mainīgo procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par mainīgo procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem”	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
Fiksēto procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fiksēto procentu likmju “vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem”	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
Uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (OIS) “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (OIS) “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem”	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
Inflācijai piesaistītu “vairāku valūtu mijmaiņas līgumi” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par inflācijai piesaistītiem “vairāku valūtu mijmaiņas līgumiem” vai “starpvalūtu mijmaiņas līgumiem”	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000

Aktīvu klase – procentu likmju atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai nav likvīda tirgus			
	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
Fiksētās un mainīgās procentu likmes “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fiksētās un mainīgās procentu likmes “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem”	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
Mainīgo procentu likmju “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par mainīgo procentu likmju “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem”	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
Fiksēto procentu likmju “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par fiksēto procentu likmju “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem”	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
Uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (OIS) “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījumu (OIS) “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem”	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
Inflācijai piesaistīti “vienas valūtas mijmaiņas līgumi” un regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par inflācijai piesaistītiem “vienas valūtas mijmaiņas līgumiem”	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
Citi procentu likmju atvasinātie instrumenti	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000

6. Kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti

6.1. tabula

Kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti – klases, kurām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti

jebkurš līgums, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma C iedaļas 4. punktā, kas attiecas uz:

- vienu vai vairākām akcijām, depozitārajiem sertifikātiem, biržā tirgotiem fondiem, sertifikātiem, citiem līdzīgiem finanšu instrumentiem, naudas plūsmām vai citiem produktiem, kas ir saistīti ar vienas vai vairāku akciju, depozitāro sertifikātu, biržā tirgotu fondu, sertifikātu vai citu līdzīgu finanšu instrumentu darbības rezultātiem;
- akciju, depozitāro sertifikātu, biržā tirgotu fondu, sertifikātu, citu līdzīgu finanšu instrumentu, naudas plūsmu vai citu produktu, kas ir saistīti ar vienas vai vairāku akciju, depozitāro sertifikātu, biržā tirgotu fondu, sertifikātu vai citu līdzīgu finanšu instrumentu darbības rezultātiem, indeksu;

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti	
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi
Akciju indeksa iespējas līgumi iespējas līgums, kura pamatā esošais atvasinātais instruments ir indekss, ko veido akcijas	tiek uzskatīts, ka visiem indeksa iespējas līgumiem ir likvids tirgus
Akciju indeksa regulētā tirgū tirgotie nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgotie nākotnes līgumi regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums, kura pamatā esošais atvasinātais instruments ir indekss, ko veido akcijas	tiek uzskatīts, ka visiem indeksa regulētā tirgū tirgotiem nākotnes līgumiem/regulētā tirgū netirgotiem nākotnes līgumiem ir likvids tirgus
Akciju iespējas līgumi iespējas līgums, kura pamatā esošais atvasinātais instruments ir akcija vai akciju grozs, kas tapis korporatīvas darbības rezultātā	tiek uzskatīts, ka visiem akciju iespējas līgumiem ir likvids tirgus
Akciju regulētā tirgū tirgotie nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgotie nākotnes līgumi regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums, kura pamatā esošais atvasinātais instruments ir akcija vai akciju grozs, kas tapis korporatīvas darbības rezultātā	tiek uzskatīts, ka visiem akciju regulētā tirgū tirgotiem nākotnes līgumiem/regulētā tirgū netirgotiem nākotnes līgumiem ir likvids tirgus
Akciju dividenžu iespējas līgumi iespējas līgums konkrētas akcijas dividendei	tiek uzskatīts, ka visiem akciju dividenžu iespējas līgumiem ir likvids tirgus
Akciju dividenžu regulētā tirgū tirgotie nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgotie nākotnes līgumi regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums konkrētas akcijas dividendei	tiek uzskatīts, ka visiem akciju dividenžu regulētā tirgū tirgotiem nākotnes līgumiem/regulētā tirgū netirgotiem nākotnes līgumiem ir likvids tirgus
Dividenžu indeksa iespējas līgumi iespējas līgums indeksam, ko veido dividendes vairāk nekā vienai akcijai	tiek uzskatīts, ka visiem dividenžu indeksa iespējas līgumiem ir likvids tirgus
Dividenžu indeksa regulētā tirgū tirgotie nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgotie nākotnes līgumi regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums indeksam, ko veido dividendes vairāk nekā vienai akcijai	tiek uzskatīts, ka visiem dividenžu indeksa regulētā tirgū tirgotiem nākotnes līgumiem/regulētā tirgū netirgotiem nākotnes līgumiem ir likvids tirgus
Svārstīguma indeksa iespējas līgums iespējas līgums, kura pamatā esošais atvasinātais instruments ir svārstīguma indeksa iespējas līgums, kas tiek definēts kā indekss, kas ir saistīts ar konkrēta pamatā esoša kapitāla vērtspapīru instrumentu indeksa svārstīgumu	tiek uzskatīts, ka visiem svārstīguma indeksa iespējas līgumiem ir likvids tirgus
Svārstīguma indeksa regulētā tirgū tirgotie nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgotie nākotnes līgumi regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums, kura pamatā esošais atvasinātais instruments ir svārstīguma indeksa iespējas līgums, kas tiek definēts kā indekss, kas ir saistīts ar konkrēta pamatā esoša kapitāla vērtspapīru instrumentu indeksa svārstīgumu	tiek uzskatīts, ka visiem svārstīguma indeksa regulētā tirgū tirgotiem nākotnes līgumiem/regulētā tirgū netirgotiem nākotnes līgumiem ir likvids tirgus
Biržā tirgotu fondu iespējas līgumi iespējas līgums, kura pamatā esošais atvasinātais instruments ir biržā tirgots fonds	tiek uzskatīts, ka visiem biržā tirgotu fondu iespējas līgumiem ir likvids tirgus
Biržā tirgotu fondu regulētā tirgū tirgotie nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgotie nākotnes līgumi regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums, kura pamatā esošais atvasinātais instruments ir biržā tirgots fonds	tiek uzskatīts, ka visiem biržā tirgotu fondu regulētā tirgū tirgotiem nākotnes līgumiem/regulētā tirgū netirgotiem nākotnes līgumiem ir likvids tirgus

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk			Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām
				Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs] Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Mijmaiņas līgumi	mijmaiņas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esoša instrumenta veids ar vienu parādnieku saistīts līgums, indekss, grozs 2. segmentācijas kritērijs – pamatā esošs ar vienu parādnieku saistīts līgums, indekss, grozs 3. segmentācijas kritērijs – parametri: cenas ieņēmumu darbības bāzes parametrs, ieņēmumu no dividendēm parametrs, ieņēmumu dispersijas parametrs, ieņēmumu svārstīguma parametrs 4. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi:			EUR 50 000 000 15
	Cenas ieņēmumu darbības bāzes parametrs	Ieņēmumu dispersijas/svārstīguma parametrs	Ieņēmumu no dividendēm parametrs	
	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	
	2. termiņu grupa: 1 mēnesis < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši	2. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši	2. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	
	3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši	3. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	3. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi	

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

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

6.2. tabula

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

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti							
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības, katru aktīvu apakšklasi turpmāk sadala apakšklasēs, kā definēts turpmāk	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības vērtības, kas noteiktas apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, pamatojoties uz tās joslas vidējo dienas nosacīto summu (ADNA), pie kuras pieder konkrētā apakšklase				
			Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA)	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
				Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
Akciju indeksa iespējas līgumi	akciju indeksa iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esošu akciju indekss	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< EUR 100 milj. ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000
			EUR 100 milj. ≤ ADNA < EUR 200 milj.	EUR 2 500 000	EUR 3 000 000	EUR 25 000 000	EUR 30 000 000
			EUR 200 milj. ≤ ADNA < EUR 600 milj.	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000	EUR 50 000 000	EUR 55 000 000
			ADNA ≥ EUR 600 milj.	EUR 15 000 000	EUR 20 000 000	EUR 150 000 000	EUR 160 000 000

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti							
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības, katru aktīvu apakšklasi turpmāk sadala apakšklasēs, kā definēts turpmāk	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības vērtības, kas noteiktas apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvids tirgus, pamatojoties uz tās joslas vidējo dienas nosacīto summu (ADNA), pie kuras pieder konkrētā apakšklase				
			Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA)	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
				Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
Akciju indeksa regulētā tirgū tirgotie nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgotie nākotnes līgumi	akciju indeksa regulētā tirgū tirgoto nākotnes līgumu/akciju regulētā tirgū netirgoto nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esošu akciju indekss	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< EUR 100 milj. ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000
			EUR 100 milj. ≤ ADNA < EUR 1 mljrd.	EUR 500 000	EUR 550 000	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000
			EUR 1 mljrd. ≤ ADNA < EUR 3 mljrd.	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000	EUR 50 000 000	EUR 55 000 000
			EUR 3 mljrd. ≤ ADNA < EUR 5 mljrd.	EUR 15 000 000	EUR 20 000 000	EUR 150 000 000	EUR 160 000 000
			ADNA ≥ EUR 5 mljrd.	EUR 25 000 000	EUR 30 000 000	EUR 250 000 000	EUR 260 000 000
Akciju iespējas līgumi	akcijas iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esoša akcija	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< EUR 5 milj. ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 250 000
			EUR 5 milj. ≤ ADNA < EUR 10 milj.	EUR 250 000	EUR 300 000	EUR 1 250 000	EUR 1 500 000
			EUR 10 milj. ≤ ADNA < EUR 20 milj.	EUR 500 000	EUR 550 000	EUR 2 500 000	EUR 3 000 000
			ADNA ≥ EUR 20 milj.	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti							
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības, katru aktīvu apakšklasi turpmāk sadala apakšklasēs, kā definēts turpmāk	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības vērtības, kas noteiktas apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvids tirgus, pamatojoties uz tās joslas vidējo dienas nosacīto summu (ADNA), pie kuras pieder konkrētā apakšklase				
			Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA)	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
				Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
Akciju regulētā tirgū tirgotie nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgotie nākotnes līgumi	akciju regulētā tirgū tirgto nākotnes līgumu/regulētā tirgū netirgto nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esoša akcija	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< EUR 5 milj. ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 250 000
			EUR 5 milj. ≤ ADNA < EUR 10 milj.	EUR 250 000	EUR 300 000	EUR 1 250 000	EUR 1 500 000
			EUR 10 milj. ≤ ADNA < EUR 20 milj.	EUR 500 000	EUR 550 000	EUR 2 500 000	EUR 3 000 000
			ADNA ≥ EUR 20 milj.	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000
Akciju dividendu iespējas līgumi	akciju dividendes iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esoša akcija, kas piešķir tiesības uz dividendēm	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< EUR 5 milj. ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 400 000	EUR 450 000
			EUR 5 milj. ≤ ADNA < EUR 10 milj.	EUR 25 000	EUR 30 000	EUR 500 000	EUR 550 000
			EUR 10 milj. ≤ ADNA < EUR 20 milj.	EUR 50 000	EUR 100 000	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000
			ADNA ≥ EUR 20 milj.	EUR 100 000	EUR 150 000	EUR 2 000 000	EUR 2 500 000

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti							
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības, katru aktīvu apakšklasi turpmāk sadala apakšklasēs, kā definēts turpmāk	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības vērtības, kas noteiktas apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvids tirgus, pamatojoties uz tās joslas vidējo dienas nosacīto summu (ADNA), pie kuras pieder konkrētā apakšklase				
			Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA)	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
				Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
Akciju dividenžu regulētā tirgū tirgotie nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgotie nākotnes līgumi	akciju dividenžu regulētā tirgū tirgoto nākotnes līgumu/regulētā tirgū netirgoto nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esoša akcija, kas piešķir tiesības uz dividendēm	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< EUR 5 milj. ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 400 000	EUR 450 000
			EUR 5 milj. ≤ ADNA < EUR 10 milj.	EUR 25 000	EUR 30 000	EUR 500 000	EUR 550 000
			EUR 10 milj. ≤ ADNA < EUR 20 milj.	EUR 50 000	EUR 100 000	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000
			ADNA ≥ EUR 20 milj.	EUR 100 000	EUR 150 000	EUR 2 000 000	EUR 2 500 000
Dividenžu indeksa iespējas līgumi	dividenžu indeksa iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esošu dividenžu indekss	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< EUR 100 milj. ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000
			EUR 100 milj. ≤ ADNA < EUR 200 milj.	EUR 2 500 000	EUR 3 000 000	EUR 25 000 000	EUR 30 000 000
			EUR 200 milj. ≤ ADNA < EUR 600 milj.	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000	EUR 50 000 000	EUR 55 000 000
			ADNA ≥ EUR 600 milj.	EUR 15 000 000	EUR 20 000 000	EUR 150 000 000	EUR 160 000 000

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti							
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības, katru aktīvu apakšklasi turpmāk sadala apakšklasēs, kā definēts turpmāk	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības vērtības, kas noteiktas apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvids tirgus, pamatojoties uz tās joslas vidējo dienas nosacīto summu (ADNA), pie kuras pieder konkrētā apakšklase				
			Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA)	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
				Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
Dividenžu indeksa regulētā tirgū tirgotie nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgotie nākotnes līgumi	dividenžu indeksa regulētā tirgū tirgoto nākotnes līgumu/regulētā tirgū netirgoto nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esošu dividenžu indekss	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< EUR 100 milj. ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000
			EUR 100 milj. ≤ ADNA < EUR 1 mljrd.	EUR 500 000	EUR 550 000	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000
			EUR 1 mljrd. ≤ ADNA < EUR 3 mljrd.	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000	EUR 50 000 000	EUR 55 000 000
			EUR 3 mljrd. ≤ ADNA < EUR 5 mljrd.	EUR 15 000 000	EUR 20 000 000	EUR 150 000 000	EUR 160 000 000
			ADNA ≥ EUR 5 mljrd.	EUR 25 000 000	EUR 30 000 000	EUR 250 000 000	EUR 260 000 000
Svārstīguma indeksa iespējas līgumi	svārstīguma indeksa iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esoša svārstīguma indekss	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< EUR 100 milj. ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000
			EUR 100 milj. ≤ ADNA < EUR 200 milj.	EUR 2 500 000	EUR 3 000 000	EUR 25 000 000	EUR 30 000 000
			EUR 200 milj. ≤ ADNA < EUR 600 milj.	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000	EUR 50 000 000	EUR 55 000 000
			ADNA ≥ EUR 600 milj.	EUR 15 000 000	EUR 20 000 000	EUR 150 000 000	EUR 160 000 000

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti							
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības, katru aktīvu apakšklasi turpmāk sadala apakšklasēs, kā definēts turpmāk	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības vērtības, kas noteiktas apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvids tirgus, pamatojoties uz tās joslas vidējo dienas nosacīto summu (ADNA), pie kuras pieder konkrētā apakšklase				
			Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA)	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
				Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
Svārstīguma indeksa regulētā tirgū tirgotie nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgotie nākotnes līgumi	svārstīguma indeksa regulētā tirgū tirgoto nākotnes līgumu/regulētā tirgū netirgoto nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esoša svārstīguma indekss	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< EUR 100 milj. ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000
			EUR 100 milj. ≤ ADNA < EUR 1 mljrd.	EUR 500 000	EUR 550 000	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000
			EUR 1 mljrd. ≤ ADNA < EUR 3 mljrd.	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000	EUR 50 000 000	EUR 55 000 000
			EUR 3 mljrd. ≤ ADNA < EUR 5 mljrd.	EUR 15 000 000	EUR 20 000 000	EUR 150 000 000	EUR 160 000 000
			ADNA ≥ EUR 5 mljrd.	EUR 25 000 000	EUR 30 000 000	EUR 250 000 000	EUR 260 000 000
Biržā tirgotu fondu iespējas līgumi	Biržā tirgotu fondu iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esošs biržā tirgots fonds	robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	< EUR 5 milj. ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 250 000
			EUR 5 milj. ≤ ADNA < EUR 10 milj.	EUR 250 000	EUR 300 000	EUR 1 250 000	EUR 1 500 000
			EUR 10 milj. ≤ ADNA < EUR 20 milj.	EUR 500 000	EUR 550 000	EUR 2 500 000	EUR 3 000 000
			ADNA ≥ EUR 20 milj.	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000

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

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

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

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti									
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības, katru aktīvu apakšklasi turpmāk sadala apakšklasēs, kā definēts turpmāk			Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības vērtības, kas noteiktas apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvids tirgus, pamatojoties uz tās joslas vidējo dienas nosacīto summu (ADNA), pie kuras pieder konkrētā apakšklase				
					Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA)	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
						Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
	m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi								
Portfeļa mijmaiņas līgumi	portfeļa mijmaiņas līgumu apakšklasi veido īpaša kombinācija: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esoša instrumenta veids ar vienu parādnieku saistīts līgums, indekss, grozs 2. segmentācijas kritērijs – pamatā esošais ar vienu parādnieku saistīts līgums, indekss, grozs 3. segmentācijas kritērijs – parametri: cenas ieņēmumu darbības bāzes parametrs, ieņēmumu no dividendēm parametrs, ieņēmumu dispersijas parametrs, ieņēmumu svārstīguma parametrs 4. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks portfeļa mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi:			robežvērtību aprēķins katrai apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	EUR 50 milj. ≤ ADNA < EUR 100 milj.	EUR 250 000	EUR 300 000	EUR 1 250 000	EUR 1 500 000
					EUR 100 milj. ≤ ADNA < EUR 200 milj.	EUR 500 000	EUR 550 000	EUR 2 500 000	EUR 3 000 000
					ADNA ≥ EUR 200 milj.	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000
	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis								

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

6.3. tabula

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

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām nav likvida tirgus			
	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
Mijmaiņas līgumi	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 100 000	EUR 150 000
Portfeļa mijmaiņas līgumi	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 100 000	EUR 150 000
Citi kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 100 000	EUR 150 000

7.1. tabula

Preču atvasinātie instrumenti – klases, kurām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām	
		Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Regulētā tirgū tirgoti preču metālu nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti preču metālu nākotnes līgumi	regulētā tirgū tirgto preču metālu nākotnes līgumu/regulētā tirgū netirgto preču metālu nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – metāla veids: dārgmetāls, nedārgmetāls 2. segmentācijas kritērijs – pamatā esošais metāls 3. segmentācijas kritērijs – nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta regulētā tirgū tirgotā nākotnes līguma/regulētā tirgū netirgotā nākotnes līguma nosacītā summa 4. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks regulētā tirgū tirgota nākotnes līguma/regulētā tirgū netirgota nākotnes līguma termiņa grupā ir definēts šādi:	EUR 10 000 000	10
	Dārgmetāli	Nedārgmetāli	
	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	
	2. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	2. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	
	3. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	3. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi	
	4. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi	...	

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti					
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk			Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām	
				Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
	...	m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi			
	m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi				
Preču metālu iespējas līgumi	preču metālu iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – metāla veids: dārgmetāls, nedārgmetāls 2. segmentācijas kritērijs – pamatā esošais metāls 3. segmentācijas kritērijs – nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta iespējas līguma nosacītā summa 4. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks iespējas līguma termiņu grupā ir definēts šādi:			EUR 10 000 000	10
	Dārgmetāli	Metāli, kas nav dārgmetāli			
	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads			
	2. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	2. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi			
	3. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	3. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi			
	4. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi	...			

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti					
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk			Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām	
				Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
	...	m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks≤ n gadi			
	m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks≤ n gadi				
Preču metālu mijmaiņas līgumi	preču metālu mijmaiņas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – metāla veids: dārgmetāls, nedārgmetāls 2. segmentācijas kritērijs – pamatā esošais metāls 3. segmentācijas kritērijs – nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta mijmaiņas līguma nosacītā summa 4. segmentācijas kritērijs – norēķina veids, kas definēts kā norēķins ar naudu, fiziskiem aktīviem vai citādi 5. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi:			EUR 10 000 000	10
	Dārgmetāli	Nedārgmetāli			
	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks≤ 3 mēneši	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks≤ 1 gads			
	2. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks≤ 1 gads	2. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks≤ 2 gadi			
	3. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks≤ 2 gadi	3. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks≤ 3 gadi			

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti					
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk			Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām	
				Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
	4. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi	...			
	...	m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi			
	m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi				
Regulētā tirgū tirgoti energopreču nākotnes līgumi/ regulētā tirgū netirgoti energopreču nākotnes līgumi	regulētā tirgū tirgto energopreču nākotnes līgumu/regulētā tirgū netirgto energopreču nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – enerģijas veids: nafta, naftas destilāti, ogles, naftas vieglās beigu frakcijas, dabasgāze, elektroenerģija, saistīti enerģētikas produkti 2. segmentācijas kritērijs – pamatā esošais energoprodukts 3. segmentācijas kritērijs – nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta regulētā tirgū tirgotā nākotnes līguma/regulētā tirgū netirgotā nākotnes līguma nosacītā summa 4. segmentācijas kritērijs – slodzes veids definēts kā bāzes slodze, augsta slodze, zema slodze vai cita veida slodze, ko piemēro enerģijas veidam: elektroenerģija 5. segmentācijas kritērijs – piegādes/naudas norēķinu vieta, ko piemēro enerģijas veidiem: nafta, naftas destilāti, naftas vieglās beigu frakcijas, elektroenerģija, saistīti enerģētikas produkti 6. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks regulētā tirgū tirgota/regulētā tirgū netirgota nākotnes līguma termiņa grupā ir definēts šādi:			EUR 10 000 000	10
	Nafta/naftas destilāti/naftas vieglās beigu frakcijas	Ogles	Dabasgāze/elektroenerģija/saistīti enerģētikas produkti		
	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 4 mēneši	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis		

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti					
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk			Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām	
				Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
	2. termiņu grupa: 4 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 8 mēneši	2. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	2. termiņu grupa: 1 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads		
	3. termiņu grupa: 8 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	3. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	3. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi		
	4. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	...	...		
	...	m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi		
	m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi				
Energopreču iespējas līgumi	energopreču iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – enerģijas veids: nafta, naftas destilāti, ogles, naftas vieglās beigu frakcijas, dabasgāze, elektroenerģija, saistīti enerģētiskie produkti 2. segmentācijas kritērijs – pamatā esošais energoprodukts 3. segmentācijas kritērijs – nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir nominēta iespējas līguma nosacītā summa 4. segmentācijas kritērijs – slodzes veids definēts kā bāzes slodze, augsta slodze, zema slodze vai cita veida slodze, ko piemēro enerģijas veidam: elektroenerģija 5. segmentācijas kritērijs – piegādes/naudas norēķinu vieta, ko piemēro enerģijas veidiem: nafta, naftas destilāti, naftas vieglās beigu frakcijas, elektroenerģija, saistīti enerģētiskie produkti 6. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks iespējas līguma termiņu grupā ir definēts šādi:			EUR 10 000 000	10

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk			Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām
				Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs] Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
	Nafta/naftas destilāti/naftas vieglās beigu frakcijas	Ogles	Dabasgāze/elektroenerģija/saistīti enerģētikas produkti	
	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 4 mēneši	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis	
	2. termiņu grupa: 4 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 8 mēneši	2. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	2. termiņu grupa: 1 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	
	3. termiņu grupa: 8 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	3. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	3. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	
	4. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	...	...	
	...	m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	
	m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi			
Energopreču mijmaiņas līgumi	energopreču mijmaiņas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – enerģijas veids: nafta, naftas destilāti, ogles, naftas vieglās beigu frakcijas, dabasgāze, elektroenerģija, saistīti enerģētikas produkti 2. segmentācijas kritērijs – pamatā esošais energoprodukts			EUR 10 000 000 10

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām		
		Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	
	3. segmentācijas kritērijs – nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta mijmaiņas līguma nosacītā summa			
	4. segmentācijas kritērijs – norēķina veids, kas definēts kā norēķins ar naudu, fiziskiem aktīviem vai citādi			
	5. segmentācijas kritērijs – slodzes veids definēts kā bāzes slodze, augsta slodze, zema slodze vai cita veida slodze, ko piemēro enerģijas veidam: elektroenerģija			
	6. segmentācijas kritērijs – piegādes/naudas norēķinu vieta, ko piemēro enerģijas veidiem: nafta, naftas destilāti, naftas vieglās beigu frakcijas, elektroenerģija, saistīti enerģētikas produkti			
	7. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi:			
	Nafta/naftas destilāti/naftas vieglās beigu frakcijas	Ogles	Dabagāze/elektroenerģija/saistīti enerģētikas produkti	
	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 4 mēneši	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši	1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 mēnesis	
2. termiņu grupa: 4 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 8 mēneši	2. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	2. termiņu grupa: 1 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads		
3. termiņu grupa: 8 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads	3. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	3. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi		
4. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi	...	...		

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

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

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

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti														
Aktīvu apakšklase	Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus													
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	SSTI pirmstirdzniecība				LIS pirmstirdzniecība		SSTI pēctirdzniecība			LIS pēctirdzniecība			
		Tirdzniecība – procentile				Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentile	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentile	Apjoms – procentile	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentile	Apjoms – procentile	Minimālā robežvērtība
Regulētā tirgū tirgoti preču metālu nākotnes līgumi/ regulētā tirgū netirgoti preču metālu nākotnes līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 250 000	70	EUR 500 000	80	60	EUR 750 000	90	70	EUR 1 000 000
		30	40	50	60									
Preču metālu iespējas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 250 000	70	EUR 500 000	80	60	EUR 750 000	90	70	EUR 1 000 000
		30	40	50	60									
Preču metālu mijmaiņas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 250 000	70	EUR 500 000	80	60	EUR 750 000	90	70	EUR 1 000 000
		30	40	50	60									

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti														
Aktīvu apakšklase	Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvids tirgus													
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	SSTI pirmstirdzniecība				LIS pirmstirdzniecība		SSTI pēctirdzniecība			LIS pēctirdzniecība			
		Tirdzniecība – procentīle				Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Apjoms – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Apjoms – procentīle	Minimālā robežvērtība
Regulētā tirgū tirgoti energopreču nākotnes līgumi/ regulētā tirgū netirgoti energopreču nākotnes līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 250 000	70	EUR 500 000	80	60	EUR 750 000	90	70	EUR 1 000 000
		30	40	50	60									
Energopreču iespējas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 250 000	70	EUR 500 000	80	60	EUR 750 000	90	70	EUR 1 000 000
		30	40	50	60									
Energopreču mijmaiņas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 250 000	70	EUR 500 000	80	60	EUR 750 000	90	70	EUR 1 000 000
		30	40	50	60									

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti														
Aktīvu apakšklase	Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvids tirgus													
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	SSTI pirmstirdzniecība				LIS pirmstirdzniecība		SSTI pēctirdzniecība			LIS pēctirdzniecība			
		Tirdzniecība – procentīle				Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Apjoms – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Apjoms – procentīle	Minimālā robežvērtība
Regulētā tirgū tirgoti lauksaimniecības preču nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti lauksaimniecības preču nākotnes līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 250 000	70	EUR 500 000	80	60	EUR 750 000	90	70	EUR 1 000 000
		30	40	50	60									
Lauksaimniecības preču iespējas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 250 000	70	EUR 500 000	80	60	EUR 750 000	90	70	EUR 1 000 000
		30	40	50	60									
Lauksaimniecības preču mijmaiņas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 250 000	70	EUR 500 000	80	60	EUR 750 000	90	70	EUR 1 000 000
		30	40	50	60									

Preču atvasinātie instrumenti – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus

Aktīvu klase – preču atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus			
	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
Regulētā tirgū tirgoti preču metālu nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti preču metālu nākotnes līgumi	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000
Preču metālu iespējas līgumi	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000
Preču metālu mijmaiņas līgumi	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000
Regulētā tirgū tirgoti energopreču nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti energopreču nākotnes līgumi	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000
Energopreču iespējas līgumi	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000
Energopreču mijmaiņas līgumi	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000
Regulētā tirgū tirgoti lauksaimniecības preču nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti lauksaimniecības preču nākotnes līgumi	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000
Lauksaimniecības preču iespējas līgumi	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000
Lauksaimniecības preču mijmaiņas līgumi	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000
Citi preču atvasinātie instrumenti	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000

8.1. tabula

Ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti – klases, kurām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti

finanšu instruments, kas attiecas uz valūtām, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma C iedaļas 4. punktā

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

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

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

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

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

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

Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām	
		Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Regulētā tirgū tirgoti ārvalstu valūtas nākotnes līgumi	regulētā tirgū tirgto ārvalstu valūtas nākotnes līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esošais valūtu pāris definēts kā divu valūtu kombinācija, kas ir atvasināto instrumentu līguma pamatā 2. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 nedēļa 2. termiņu grupa: 1 nedēļa < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 mēneši 3. termiņu grupa: 3 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads 4. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi 5. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi ... m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	tiek uzskatīts, ka regulētā tirgū tirgotiem ārvalstu valūtas nākotnes līgumiem nav likvīda tirgus	
Aktīvu klase – ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi		
Citi ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti			
ārvalstu valūtas atvasinātais instruments, kas nepieder nevienai no iepriekšminētajām aktīvu apakšklasēm	par visiem pārējiem ārvalstu valūtas atvasinātajiem instrumentiem uzskata, ka tiem nav likvīda tirgus		

Ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus

Aktīvu klase – ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām nav likvida tirgus			
	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
Regulētā tirgū netirgots nepiegādājams nākotnes līgums (NDF)	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Regulētā tirgū netirgots piegādājams nākotnes līgums (DF)	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Nepiegādājami ārvalstu valūtas iespējas līgumi (NDO)	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Piegādājami ārvalstu valūtas iespējas līgumi (DO)	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Nepiegādājami ārvalstu valūtas mijmaiņas līgumi (NDS)	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Piegādājami ārvalstu valūtas mijmaiņas līgumi (DS)	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Regulētā tirgū tirgoti ārvalstu valūtas nākotnes līgumi	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Citi ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000

9.1. tabula

Vērtspapīroti atvasinātie instrumenti – klases, kurām nav likvīda tirgus

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

Aktīvu klase – kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām Attiecībā uz apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām ir likvīds tirgus, vajadzības gadījumā piemēro papildu kvalitatīvo likviditātes kritēriju		
		Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Indeksa “likviditātes” statuss [Papildu kvalitatīvais likviditātes kritērijs]
Ar vienu parādnienu saistīts kredītriska mijmaiņas līgums (CDS) mijmaiņas līgums, kura naudas plūsmu apmaiņa ir saistīta ar indeksu veidojošo finanšu instrumentu viena emitenta kredīspēju un kredītnotikumiem	ar vienu parādnienu saistīta kredītriska mijmaiņas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – pamatā esošā atsaucē struktūra 2. segmentācijas kritērijs – pamatā esošās atsaucē struktūras veids, kas definēts šādi: “Valsts un publiskā sektora emitents” ir emitenta struktūra, kas ir a) Savienība; b) dalībvalsts, tostarp dalībvalsts valdības departaments, aģentūra vai īpašam nolūkam dibināta sabiedrība; c) valsts struktūra, kas nav minēta a) un b) apakšpunktā; d) federālas dalībvalsts gadījumā – minētās federācijas loceklis; e) vairāku dalībvalstu īpašam nolūkam dibināta sabiedrība; f) starptautiska finanšu iestāde, kuru izveidojušas divas vai vairākas dalībvalstis un kuras uzdevums ir nodrošināt finansējumu un sniegt finanšu palīdzību tās locekļiem, kurus piemeklējušas smagas finansiāla rakstura problēmas vai kuriem tādas draud; g) Eiropas Investīciju banka; h) publiska struktūra, kas nav valsts emitents, kā norādīts a) līdz c) apakšpunktā. “Kolektīvo ieguldījumu emitents” ir emitenta struktūra, kas nav valsts un publiskā sektora emitents. 3. segmentācijas kritērijs – nosacītā valūta ir definēta kā valūta, kurā ir denominēta atvasinātā instrumenta nosacītā summa 4. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks kredītriska mijmaiņas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads 2. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi 3. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi ... m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	EUR 10 000 000	10	

Aktīvu klase – kredītu atvasinātie instrumenti		
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst šādam kvalitatīvajam likviditātes kritērijam
Kreditriskā mijmaiņas darījuma indeksa iespējas līgumi iespējas līgums, kura pamatā esošais instruments ir kreditriskā mijmaiņas darījuma indekss	kreditriskā mijmaiņas darījumu indeksa iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – kreditriskā mijmaiņas darījumu indeksa apakšklase, kā precizēts attiecībā uz indeksa kreditriskā mijmaiņas darījumu aktīvu apakšklasi 2. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks iespējas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 2. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads 3. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi 4. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi ... m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	kreditriskā mijmaiņas darījumu indeksa iespējas līgums, kura pamatā esošais kreditriskā mijmaiņas darījumu indekss ir apakšklase, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus, un kura līdz termiņam atlikušais laiks termiņu grupā ir 0 līdz 6 mēneši, un par kuru tiek uzskatīts, ka tam ir likvīds tirgus kreditriskā mijmaiņas darījumu indeksa iespējas līgums, kura pamatā esošais kreditriskā mijmaiņas darījumu indekss ir apakšklase, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus, un kura līdz termiņam atlikušais laiks termiņu grupā nav 0 līdz 6 mēneši, un par kuru netiek uzskatīts, ka tam ir likvīds tirgus kreditriskā mijmaiņas darījumu indeksa iespējas līgums, kura pamatā esošo kreditriskā mijmaiņas darījumu indekss ir tāda apakšklase, par kuru uzskata, ka tai nav likvīda tirgus, par kuru uzskata, ka tai nav likvīda tirgus konkrētajā līdz termiņam atlikušajā laikā
Ar vienu parādnienu saistītā kreditriskā mijmaiņas darījumu iespējas līgumi iespējas līgums, kura pamatā esošais atvasinātais instruments ir ar vienu parādnienu saistītā kreditriskā mijmaiņas darījums	ar vienu parādnienu saistītā kreditriskā mijmaiņas darījumu iespējas līgumu apakšklasi definē saskaņā ar šādiem segmentācijas kritērijiem: 1. segmentācijas kritērijs – ar vienu parādnienu saistītā kreditriskā mijmaiņas darījuma apakšklase, kā precizēts attiecībā uz ar vienu parādnienu saistītā kreditriskā mijmaiņas darījumu aktīvu apakšklasi 2. segmentācijas kritērijs – līdz termiņam atlikušais laiks iespējas līguma termiņu grupā ir definēts šādi: 1. termiņu grupa: 0 < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 6 mēneši 2. termiņu grupa: 6 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads 3. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi 4. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi ... m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi	ar vienu parādnienu saistītā kreditriskā mijmaiņas darījumu iespējas līgums, kura pamatā esošais ar vienu parādnienu saistītā kreditriskā mijmaiņas darījums ir apakšklase, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus, un kura līdz termiņam atlikušais laiks termiņu grupā ir 0 līdz 6 mēneši, un par kuru tiek uzskatīts, ka tam ir likvīds tirgus ar vienu parādnienu saistītā kreditriskā mijmaiņas darījumu iespējas līgums, kura pamatā esošais ar vienu parādnienu saistītā kreditriskā mijmaiņas darījums ir apakšklase, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus, un kura līdz termiņam atlikušais laiks termiņu grupā nav 0 līdz 6 mēneši, un par kuru netiek uzskatīts, ka tam ir likvīds tirgus ar vienu parādnienu saistītā kreditriskā mijmaiņas darījumu iespējas līgums, kura pamatā esošais ar vienu parādnienu saistītā kreditriskā mijmaiņas darījums ir tāda apakšklase, par kuru uzskata, ka tai nav likvīda tirgus, par kuru uzskata, ka tai nav likvīda tirgus konkrētajā līdz termiņam atlikušajā laikā
Aktīvu klase – kredītu atvasinātie instrumenti		
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi	
Citi kredītu atvasinātie instrumenti kredītu atvasinātais instruments, kas nepieder nevienai no iepriekšminētajām aktīvu apakšklasēm	par visiem pārējiem kredītu atvasinātajiem instrumentiem uzskata, ka tiem nav likvīda tirgus	

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

Aktīvu klase – kredītu atvasinātie instrumenti														
Aktīvu apakšklase	Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvīds tirgus													
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	SSTI pirmstirdzniecība				LIS pirmstirdzniecība		SSTI pēctirdzniecība			LIS pēctirdzniecība			
		Tirdzniecība – procentile				Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentile	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentile	Apjoms – procentile	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentile	Apjoms – procentile	Minimālā robežvērtība
Indeksa kredītriska mijmaiņas darījums	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 2 500 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 7 500 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									
Ar vienu parādnieku saistīts kredītriska mijmaiņas līgums	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 2 500 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 7 500 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									
Nestandardizēts ar vairākiem parādniekiem saistīts kredītriska mijmaiņas līgums (CDS)	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 2 500 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 7 500 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									

Aktīvu klase – kredītu atvasinātie instrumenti														
Aktīvu apakšklase	Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvids tirgus													
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	SSTI pirmstirdzniecība				LIS pirmstirdzniecība		SSTI pēctirdzniecība			LIS pēctirdzniecība			
		Tirdzniecība – procentīle				Tirdzniecība – procentīle		Tirdzniecība – procentīle			Tirdzniecība – procentīle			
		Tirdzniecība – procentīle	Minimālā robežvērtība				Tirdzniecība – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Apjoms – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Apjoms – procentīle	Minimālā robežvērtība
Kredītriska mijmaiņas darījuma indeksa iespējas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 2 500 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 7 500 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									
Ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas darījumu iespējas līgumi	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 2 500 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 7 500 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									

Kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus

Aktīvu klase – kredītu atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām nav likvida tirgus			
	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
Indeksa kredītriska mijmaiņas darījums (CDS)	EUR 2 500 000	EUR 5 000 000	EUR 7 500 000	EUR 10 000 000
Ar vienu parādnieku saistīts kredītriska mijmaiņas līgums (CDS)	EUR 2 500 000	EUR 5 000 000	EUR 7 500 000	EUR 10 000 000
Nestandardizēts ar vairākiem parādniekiem saistīts kredītriska mijmaiņas līgums (CDS)	EUR 2 500 000	EUR 5 000 000	EUR 7 500 000	EUR 10 000 000
Kredītriska mijmaiņas darījuma indeksa iespējas līgumi	EUR 2 500 000	EUR 5 000 000	EUR 7 500 000	EUR 10 000 000
Ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas darījumu iespējas līgumi	EUR 2 500 000	EUR 5 000 000	EUR 7 500 000	EUR 10 000 000
Citi kredīta atvasinātie instrumenti	EUR 2 500 000	EUR 5 000 000	EUR 7 500 000	EUR 10 000 000

C10 atvasinātie instrumenti – klases, kurām nav likvīda tirgus

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

Aktīvu klase – C10 atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus saskaņā ar 6. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām	
		Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
	5. termiņu grupa: 9 mēneši < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 1 gads 6. termiņu grupa: 1 gads < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 2 gadi 7. termiņu grupa: 2 gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ 3 gadi ... m termiņu grupa: (n-1) gadi < līdz termiņam atlikušais laiks ≤ n gadi		
Aktīvu klase – C10 atvasinātie instrumenti			
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi		
Pārējie C10 atvasinātie instrumenti finanšu instruments, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma C iedaļas 10. punktā, kas nav “kravas pārvaldījumu likmes atvasinātais instruments”, jebkura no turpmāk minētajiem procentu likmju atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasēm:” Inflācijai piesaistītu vairāku valūtu mijmaiņas līgums vai starpvalūtu mijmaiņas līgums”, regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par inflācijai piesaistītu vairāku valūtu mijmaiņas līgumu vai starpvalūtu mijmaiņas līgumu”, inflācijai piesaistīts vienas valūtas mijmaiņas līgums”, regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par inflācijai piesaistītu vienas valūtas mijmaiņas līgumu “un kāda no turpmāk minētajām kapitāla vērtspāpīru atvasināto instrumentu aktīvu apakšklasēm:” Svārstīguma indeksa iespējas līgums”, svārstīguma indeksa regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi”, mijmaiņas līgums ar ieņēmumu dispersijas parametru, mijmaiņas līgums ar ieņēmumu svārstīguma parametru, portfeļa mijmaiņas līgums ar ieņēmumu dispersijas parametru, portfeļa mijmaiņas līgums ar ieņēmumu svārstīguma parametru”	par visiem pārējiem C10 atvasinātajiem instrumentiem uzskata, ka tiem nav likvida tirgus		

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

Aktīvu klase – C10 atvasinātie instrumenti														
Aktīvu apakšklase	Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatēts, ka tai ir likvids tirgus													
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	SSTI pirmstirdzniecība				LIS pirmstirdzniecība		SSTI pēctirdzniecība			LIS pēctirdzniecība			
		Tirdzniecība – procentile				Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentile	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentile	Apjoms – procentile	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentile	Apjoms – procentile	Minimālā robežvērtība
Kravu pārveidājumu likmes atvasinātie instrumenti	robežvērtību aprēķins katrai aktīvu apakšklases apakšklasei būtu jāveic, ņemot vērā izpildītos darījumus ar finanšu instrumentiem, kas pieder attiecīgajai apakšklasei	S1	S2	S3	S4	EUR 25 000	70	EUR 50 000	80	60	EUR 75 000	90	70	EUR 100 000
		30	40	50	60									

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

Aktīvu klase – C10 atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības apakšklasēm, par kurām konstatēts, ka tām nav likvīda tirgus			
	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
Kravu pārveidatājumus likmes atvasinātie instrumenti	EUR 25 000	EUR 50 000	EUR 75 000	EUR 100 000
Citi C10 atvasinātie instrumenti	EUR 25 000	EUR 50 000	EUR 75 000	EUR 100 000

11. Finanšu līgumi par cenu starpībām

11.1. tabula

Līgumi par cenu starpībām – klases, kurām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – līgumi par cenu starpībām (CFD)				
atvasināto instrumentu līgums, kas ilgtermiņā vai īstermiņā pakļauj tā turētāju riskam, ko rada cenu starpība starp pamatā esošā aktīva cenu līguma sākumā un tā cenu brīdī, kad līgums tiek slēgts				
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvalitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām		
		Kvalitatīvais likviditātes kritērijs	Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Līgumi par valūtas cenu starpībām	līguma par valūtas cenu starpībām apakšklasi raksturo pamatā esošais valūtu pāris, kas definēts kā divu valūtu kombinācija, kas ir līguma par cenu starpībām/starpību derību līguma pamatā		EUR 50 000 000	100
Līgumi par preču cenu starpībām	līguma par preču cenu starpībām apakšklasi definē pamatā esošais līgums par preču cenu starpībām/starpību derību līgums		EUR 50 000 000	100
Līgumi par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām	līguma par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām apakšklasi definē pamatā esošais līgums par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām/starpību derību līgums	uzskata, ka līguma par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām apakšklasei ir likvīds tirgus, ja pamatā esošais instruments ir kapitāla vērtspapīrs, kuram ir likvīds tirgus, kā noteikts saskaņā ar Regulas (ES) Nr. 600/2014 2. panta 1. punkta 17. apakšpunkta b) punktu		
Līgumi par obligāciju cenu starpību	līguma par obligāciju cenu starpībām apakšklasi definē pamatā esošā obligācija vai līguma par cenu starpībām regulētā tirgū tirgots obligāciju nākotnes līgums/starpību derību līgums	uzskata, ka līguma par kapitāla obligāciju cenu starpībām apakšklasei ir likvīds tirgus, ja pamatā esošais instruments ir obligācija vai regulētā tirgū tirgots obligāciju nākotnes līgums, kuram ir likvīds tirgus, kā noteikts saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu.		

Aktīvu klase – līgumi par cenu starpībām (CFD)				
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, katru aktīvu apakšklasi sīkāk iedala apakšklasēs, kā noteikts turpmāk	Par katru apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvalitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām		
		Kvalitatīvais likviditātes kritērijs	Dienas vidējā nosacītā summa (ADNA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Līgumi par cenu starpībām par regulētā tirgū tirgotiem kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumiem/regulētā tirgū netirgotiem kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumiem	līguma par cenu starpībām par regulētā tirgū tirgotu kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumu/regulētā tirgū netirgotu kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumu apakšklasi definē pamatā esošais regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots nākotnes līgums par līguma par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām/starpību derību līgumu	uzskata, ka līguma par cenu starpībām par regulētā tirgū tirgotu kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumu/regulētā tirgū netirgotu kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumu apakšklasei ir likvīds tirgus, ja pamatā esošais instruments ir regulētā tirgū tirgots kapitāla vērtspapīru nākotnes līgums/regulētā tirgū netirgots kapitāla vērtspapīru nākotnes līgums, kuram ir likvīds tirgus, kā noteikts saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu.		
Līgumi par cenu starpībām par kapitāla vērtspapīru iespējas līgumiem	līguma par cenu starpībām par kapitāla vērtspapīru iespējas līgumiem apakšklasi definē pamatā esošais iespējas līgums par līguma par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām/starpību derību līgumu	uzskata, ka līguma par kapitāla vērtspapīru iespējas līgumu cenu starpībām apakšklasei ir likvīds tirgus, ja pamatā esošais instruments ir kapitālā vērtspapīru iespējas līgums, kuram ir likvīds tirgus, kā noteikts saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu.		
Aktīvu klase – finanšu līgumi par cenu starpībām (CFD)				
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klases, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi			
Citi līgumi par cenu starpībām	par visiem pārējiem līgumiem par cenu starpībām/starpību derību līgumiem uzskata, ka tiem nav likvīda tirgus			
līgums par cenu starpībām/starpību derību līgums, kas nepieder nevienai no iepriekšminētajām aktīvu apakšklasēm				

Līgumi par cenu starpībām – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības apakšklasēm, par kuram uzskata, ka tām ir likvids tirgus

Aktīvu klase – līgumi par cenu starpībām (CFD)														
Aktīvu apakšklase	Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatē, ka tai ir likvids tirgus													
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	SSTI pirmstirdzniecība				LIS pirmstirdzniecība		SSTI pēctirdzniecība			LIS pēctirdzniecība			
		Tirdzniecība – procentīle				Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Apjoms – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Apjoms – procentīle	Minimālā robežvērtība
Līgumi par valūtas cenu starpībām	darījumi, kas veikti ar līgumu par valūtas cenu starpībām, par kuriem uzskata, ka tiem ir likvids tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu	S1	S2	S3	S4	EUR 50 000	70	EUR 60 000	80	60	EUR 90 000	90	70	EUR 100 000
		30	40	50	60									
Līgumi par preču cenu starpībām	darījumi, kas veikti ar līgumu par preču cenu starpībām, par kuriem uzskata, ka tiem ir likvids tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu	S1	S2	S3	S4	EUR 50 000	70	EUR 60 000	80	60	EUR 90 000	90	70	EUR 100 000
		30	40	50	60									
Līgumi par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām	darījumi, kas veikti ar līgumu par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām, par kuriem uzskata, ka tiem ir likvids tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu	S1	S2	S3	S4	EUR 50 000	70	EUR 60 000	80	60	EUR 90 000	90	70	EUR 100 000
		30	40	50	60									

Aktīvu klase – līgumi par cenu starpībām (CFD)														
Aktīvu apakšklase	Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katrai apakšklasei, par kuru konstatē, ka tai ir likvids tirgus													
	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	SSTI pirmstirdzniecība				LIS pirmstirdzniecība		SSTI pēctirdzniecība			LIS pēctirdzniecība			
		Tirdzniecība – procentīle				Tirdzniecība – procentīle		Tirdzniecība – procentīle			Tirdzniecība – procentīle			
Līgumi par obligāciju cenu starpībām	darījumi, kas veikti ar līgumiem par obligāciju cenu starpībām, par kuriem uzskata, ka tiem ir likvids tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu	S1	S2	S3	S4	EUR 50 000	70	EUR 60 000	80	60	EUR 90 000	90	70	EUR 100 000
		30	40	50	60									
Līgumi par cenu starpībām par regulētā tirgū tirgotiem kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumiem/regulētā tirgū netirgotiem kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumiem	darījumi, kas veikti ar līgumiem par cenu starpībām par regulētā tirgū tirgotiem kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumiem, par kuriem uzskata, ka tiem ir likvids tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu	S1	S2	S3	S4	EUR 50 000	70	EUR 60 000	80	60	EUR 90 000	90	70	EUR 100 000
		30	40	50	60									
Līgumi par cenu starpībām par kapitāla vērtspapīru iespējas līgumiem	darījumi, kas veikti ar līgumiem par cenu starpībām par kapitāla vērtspapīru iespējas līgumiem, par kuriem uzskata, ka tiem ir likvids tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu	S1	S2	S3	S4	EUR 50 000	70	EUR 60 000	80	60	EUR 90 000	90	70	EUR 100 000
		30	40	50	60									

Līgumi par cenu starpībām – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus

Aktīvu klase – finanšu līgumi par cenu starpībām (CFD)				
Aktīvu apakšklase	Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus			
	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
Līgumi par valūtas cenu starpībām	EUR 50 000	EUR 60 000	EUR 90 000	EUR 100 000
Līgumi par preču cenu starpībām	EUR 50 000	EUR 60 000	EUR 90 000	EUR 100 000
Līgumi par kapitāla vērtspapīru cenu starpībām	EUR 50 000	EUR 60 000	EUR 90 000	EUR 100 000
Līgumi par obligāciju cenu starpībām	EUR 50 000	EUR 60 000	EUR 90 000	EUR 100 000
Līgumi par cenu starpībām par regulētā tirgū tirgotiem kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumiem/regulētā tirgū netirgotiem kapitāla vērtspapīru nākotnes līgumiem	EUR 50 000	EUR 60 000	EUR 90 000	EUR 100 000
Līgumi par cenu starpībām par kapitāla vērtspapīru iespējas līgumiem	EUR 50 000	EUR 60 000	EUR 90 000	EUR 100 000
Citi līgumi par cenu starpībām/starpību derību līgumi	EUR 50 000	EUR 60 000	EUR 90 000	EUR 100 000

12. Emisijas kvotas

12.1. tabula

Emisijas kvotas – klases, kurām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – emisijas kvotas		
Aktīvu apakšklase	Par katru aktīvu apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām	
	Dienas vidējā summa (ADA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Eiropas Savienības emisijas kvotas (EUA) jebkura struktūra, kas atzīta par atbilstīgu Eiropas Parlamenta un Padomes Direktīvas 2003/87/EK ⁽¹⁾ prasībām (emisijas kvotu tirdzniecības sistēma), kas atbilst tiesībām emitēt vienu tonnu oglekļa dioksīda (tCO ₂ e) ekvivalenta	150 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	5
Eiropas Savienības aviācijas nozares kvotas (EUAA) jebkura struktūra, kas atzīta par atbilstīgu Direktīvas 2003/87/EK prasībām (emisijas kvotu tirdzniecības sistēma), kas atbilst tiesībām aviācijas darbību rezultātā emitēt vienu tonnu oglekļa dioksīda (tCO ₂ e) ekvivalenta	150 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	5
Sertificētas emisijas samazināšana (EUA) jebkura struktūra, kas atzīta par atbilstīgu Direktīvas 2003/87/EK prasībām (emisijas kvotu tirdzniecības sistēma), kas samazina emisijas vienas tonnas oglekļa dioksīda (tCO ₂ e) ekvivalenta apmērā	150 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	5
Emisijas samazināšanas vienības (ERU) jebkura struktūra, kas atzīta par atbilstīgu Direktīvas 2003/87/EK prasībām (emisijas kvotu tirdzniecības sistēma), kas samazina emisijas vienas tonnas oglekļa dioksīda (tCO ₂ e) ekvivalenta apmērā	150 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	5

⁽¹⁾ Eiropas Parlamenta un Padomes 2003. gada 13. oktobra Direktīva 2003/87/EK, ar kuru nosaka sistēmu siltumnīcas efektu izraisošo gāzu emisijas kvotu tirdzniecībai Kopienā un groza Padomes Direktīvu 96/61/EK (OV L 275, 25.10.2003., 32. lpp.).

Emisijas kvotas – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības aktīvu apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām ir likvids tirgus

Aktīvu klase – emisijas kvotas													
Aktīvu apakšklase	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katrai aktīvu apakšklasei, par kuru konstatē, ka tai ir likvids tirgus											
		SSTI pirmstirdzniecība				LIS pirmstirdzniecība		SSTI pēctirdzniecība		LIS pēctirdzniecība			
		Tirdzniecība – procentīle		Minimālā robežvērtība		Tirdzniecība – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Minimālā robežvērtība	Tirdzniecība – procentīle	Minimālā robežvērtība		
Eiropas Savienības emisijas kvotas (EUA)	darījumi, kas izpildīti attiecībā uz visām Eiropas Savienības emisijas kvotām (EUA)	S1	S2	S3	S4	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	70	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	80	90 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	90	100 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	
		30	40	50	60								
Eiropas Savienības aviācijas nozares kvotas (EUAA)	darījumi, kas izpildīti attiecībā uz visām Eiropas Savienības aviācijas nozares kvotām (EUA)	S1	S2	S3	S4	20 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	70	25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	80	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	90	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	
		30	40	50	60								
Sertificēta emisiju samazināšana (CER)	darījumi, kas izpildīti attiecībā uz visu sertificētu emisiju samazināšanu	S1	S2	S3	S4	20 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	70	25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	80	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	90	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	
		30	40	50	60								
Emisiju samazināšanas vienības (ERU)	darījumi, kas izpildīti attiecībā uz visām emisiju samazināšanas vienībām	S1	S2	S3	S4	20 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	70	25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	80	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	90	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	
		30	40	50	60								

Emisijas kvotas – pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības aktīvu apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – emisijas kvotas				
Aktīvu apakšklase	Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām nav likvīda tirgus			
	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
Eiropas Savienības emisijas kvotas (EUA)	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	90 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	100 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas
Eiropas Savienības aviācijas nozares kvotas (EUAA)	20 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas
Sertificēta emisiju samazināšana (CER)	20 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas
Emisiju samazināšanas vienības (ERU)	20 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas

13. Emisiju kvotu atvasinātie instrumenti

13.1. tabula

Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti – klases, kurām nav likvīda tirgus

Aktīvu klase – emisijas kvotu atvasinātie instrumenti		
Aktīvu apakšklase	Par katru aktīvu apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām	
	Dienas vidējā summa (ADA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir Eiropas Savienības emisijas kvotu (EUA) veids finanšu instruments, kas attiecas uz emisijas kvotām, kas ir Eiropas Savienības emisijas kvotu veids, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma C iedaļas 4. punktā	150 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	5

Aktīvu klase – emisijas kvotu atvasinātie instrumenti		
Aktīvu apakšklase	Par katru aktīvu apakšklasi uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, ja tā neatbilst vienai vai visām šādām kvantitatīvo likviditātes kritēriju robežvērtībām	
	Dienas vidējā summa (ADA) [1. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]	Dienas vidējais darījumu skaits [2. kvantitatīvais likviditātes kritērijs]
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir Eiropas Savienības aviācijas nozares kvotu (EUA) veids finanšu instruments, kas attiecas uz emisijas kvotām, kas ir Eiropas Savienības aviācijas nozares kvotu veids, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma C iedaļas 4. punktā	150 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	5
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, uz kuru pamatā esošo instrumentu attiecas Sertificētas emisijas samazināšana (EUA) finanšu instruments, kas attiecas uz emisijas kvotām, uz ko attiecas Sertificētas emisijas samazināšana, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma C iedaļas 4. punktā	150 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	5
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no Emisijas samazināšanas vienībām (EUA) finanšu instruments, kas attiecas uz emisijas kvotām, kas ir emisijas samazināšanas vienību veids, kā definēts Direktīvas 2014/65/ES I pielikuma C iedaļas 4. punktā	150 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	5
Aktīvu klase – emisijas kvotu atvasinātie instrumenti		
Aktīvu apakšklase	Lai noteiktu finanšu instrumentu klasi, par kuru uzskata, ka tai nav likvīda tirgus saskaņā ar 6. pantu un 8. panta 1. punkta b) apakšpunktu, piemēro šādu metodi	
Citi emisijas kvotu atvasinātie instrumenti emisijas kvotu atvasinātais instruments, kura pamatā nav Eiropas Savienības emisijas kvotas (EUA), Eiropas Savienības aviācijas nozares kvotas (EUAA), sertificētas emisijas samazināšanas vienības (CER) un emisijas samazināšanas vienības (ERU)	visi pārējie emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, par kuriem uzskata, ka tiem nav likvīda tirgus	

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

Aktīvu klase – emisijas kvotu atvasinātie instrumenti											
Aktīvu apakšklase	Darījumi, kas jāņem vērā, aprēķinot robežvērtības	Procentīles un minimālās robežvērtības, kas jāpiemēro, aprēķinot pirmstirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības katrai aktīvu apakšklasei, par kuru konstatē, ka tai ir likvids tirgus									
		SSTI pirmstirdzniecība				LIS pirmstirdzniecība		SSTI pēctirdzniecība		LIS pēctirdzniecība	
		Tirdzniecība – procentīle				Minimālā robežvērtība		Tirdzniecība – procentīle		Minimālā robežvērtība	
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no Eiropas Savienības emisijas kvotām (EUA)	darījumi, kas izpildīti ar visiem emisijas kvotu atvasinātajiem instrumentiem, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no Eiropas Savienības emisijas kvotām (EUA)	S1	S2	S3	S4	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas		70		50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	
		30	40	50	60						
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no Eiropas Savienības aviācijas nozares kvotām (EUAA)	darījumi, kas izpildīti ar visiem emisijas kvotu atvasinātajiem instrumentiem, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no Eiropas Savienības aviācijas nozares kvotām (EUAA)	S1	S2	S3	S4	20 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas		70		25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	
		30	40	50	60						
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no sertificētas emisijas samazināšanas vienībām (CER)	darījumi, kas izpildīti ar visiem emisijas kvotu atvasinātajiem instrumentiem, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no sertificētas emisijas samazināšanas vienībām (CER)	S1	S2	S3	S4	20 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas		70		25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	
		30	40	50	60						
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no emisijas samazināšanas vienībām (ERU)	darījumi, kas izpildīti ar visiem emisijas kvotu atvasinātajiem instrumentiem, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no emisijas samazināšanas vienībām (ERU)	S1	S2	S3	S4	20 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas		70		25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	
		30	40	50	60						

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

Aktīvu klase – emisijas kvotu atvasinātie instrumenti				
Aktīvu apakšklase	Pirmstirdzniecības un pēctirdzniecības SSTI un LIS robežvērtības aktīvu apakšklasēm, par kurām uzskata, ka tām nav likvida tirgus			
	SSTI pirmstirdzniecība	LIS pirmstirdzniecība	SSTI pēctirdzniecība	LIS pēctirdzniecība
	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība	Robežvērtības vērtība
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no Eiropas Savienības emisijas kvotām (EUA)	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	90 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	100 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no Eiropas Savienības aviācijas nozares kvotām (EUAA)	20 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no sertificētas emisijas samazināšanas vienībām (CER)	20 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas
Emisijas kvotu atvasinātie instrumenti, kuru pamatā esošais instruments ir kāda no emisijas samazināšanas vienībām (ERU)	20 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas
Citi emisiju kvotu atvasinātie instrumenti	20 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	25 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	40 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas	50 000 oglekļa dioksīda ekvivalenta tonnas

IV PIELIKUMS

Atsauces dati, kas jāsniedz pārredzamības aprēķinu nolūkā

1. tabula

2. tabulas simbolu tabula

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

SIMBOLS	DATU TIPS	DEFINĪCIJA
		“MOSP” – MOSPRIM “NIBO” – NIBOR “PRBO” – PRIBOR “TLBO” – TELBOR “WIBO” – WIBOR “TREA” – valsts parādzīmes “SWAP” – mijmaiņas darījums “FUSW” – regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums par mijmaiņas līgumu

2. tabula

Pārskats par atsauces datiem, kas jāsniedz pārredzamības aprēķinu nolūkā

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

#	LAUKS	SNIEDZAMĀS ZIŅAS	ZIŅOJUMU IESNIEGŠANAS FORMĀTS
5	Līguma veids	Jāaizpilda, ja FITR identifikators ir atvasinātais instruments.	“OPTN” – iespējas līgums “FUTR” – nākotnes līgums “FRAS” – regulētā tirgū netirgots procentu likmes nākotnes līgums (<i>FRA</i>) “FORW” – regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi “SWAP” – mijmaiņas darījums “SWAP” – portfeļa mijmaiņas darījums “SWPT” – mijmaiņas iespējas līgumi “FONS” – regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi par mijmaiņas līgumu “FWOS” – regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par mijmaiņas līgumu “FFAS” – regulētā tirgū netirgots kravas nākotnes līgums (<i>FFA</i>) “SPDB” – starpības derības “CFDS” – līgums par cenu starpību “OTHR” – cits
6	Ziņošanas diena	Diena, par kuru sniedz atsauces datus	{DATEFORMAT}
7	Tirdzniecības vieta	Segments <i>MIC</i> attiecībā uz tirdzniecības vietu, ja ir pieejams; pretējā gadījumā operatora <i>MIC</i> .	{MIC}
8	Terminš	Finanšu instrumenta terminš Lauks, kurā norāda obligāciju aktīvu klases, procentu likmju atvasinātos instrumentus, kapitāla vērtspapīru atvasinātos instrumentus, preču atvasinātos instrumentus, ārvalstu valūtas atvasinātos instrumentus, kredītu atvasinātos instrumentus, <i>C10</i> atvasinātos instrumentus un emisijas kvotu atvasinātos instrumentus.	{DATEFORMAT}

Obligācijas (visi obligāciju veidi, izņemot ar biržā tirgotām precēm un biržā tirgotām parādzīmēm saistītos laukus)

9	Obligācijas veids	Obligāciju veids, kā precizēts III pielikuma 2. iedaļas 2.2. tabulā. Jāaizpilda tikai, ja FITR identifikators ir līdzvērtīgs obligācijām.	“EUSB” – valsts obligācija “OEPB” – cita valsts obligācija “CVTB” – konvertējama obligācija “CVDB” – segtā obligācija “CVPB” – uzņēmuma obligācija “OTHR” – cits
10	Emisijas datums	Datums, kurā obligācija ir emitēta un sāk uzkrāt procentus.	{DATEFORMAT}

Ar emisijas kvotām saistītie lauki

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

11	Emisijas kvotu paveids	Emisijas kvotas	“CERE” – sertificētas emisijas samazināšanas vienība (<i>CER</i>) “ERUE” – emisijas samazināšanas vienība (<i>ERU</i>) “EUAE” – emisijas kvota “EUAA” – aviācijas nozares kvota
----	------------------------	-----------------	--

#	LAUKS	SNIEDZAMĀS ZIŅAS	ZIŅOJUMU IESNIEGŠANAS FORMĀTS
---	-------	------------------	-------------------------------

Ar atvasinātajiem instrumentiem saistītie lauki**Preču atvasinātie instrumenti un C10 atvasinātie instrumenti**

12	Ar kravas paveidu saistīta apjoma apraksts	Jāaizpilda, ja bāzes produkts, kas precizēts Komisijas Deleģētās regulas (ES) 2017/585 pielikuma 2. tabulas 35. laukā, ir līdzvērtīgs kravai.	{ALPHANUM-25}
13	Konkrēta maršruta vai fraktēšanas vidējais rādītājs	Jāaizpilda, ja bāzes produkts, kas precizēts Komisijas Deleģētās regulas (ES) 2017/585 pielikuma 2. tabulas 35. laukā, ir līdzvērtīgs kravai.	{ALPHANUM-25}
14	Piegādes/norēķina ar naudu vieta	Jāaizpilda, ja bāzes produkts, kas precizēts Komisijas Deleģētās regulas (ES) 2017/585 pielikuma 2. tabulas 35. laukā, ir līdzvērtīgs enerģijai.	{ALPHANUM-25}
15	Nosacītā valūta	Valūta, kurā ir denominēta teorētiskā pamatsumma	{CURRENCYCODE_3}

Procentu likmju atvasinātie instrumenti

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

16	Pamatā esošā instrumenta veids	Jāaizpilda attiecībā uz līguma veidu, kas nav mijmaiņas līgumi, mijmaiņas iespējas līgumi, regulētā tirgū tirgoti līgumi par mijmaiņas līgumu un regulētā tirgū netirgoti līgumi par mijmaiņas līgumu, ar kādu no norādītajiem variantiem Jāaizpilda ar kādu no norādītajiem variantiem attiecībā uz mijmaiņas līgumiem, mijmaiņas iespējas līgumiem, regulētā tirgū tirgotiem līgumiem par mijmaiņas līgumu un regulētā tirgū netirgotiem līgumiem par mijmaiņas līgumu, ņemot vērā pamatā esošo mijmaiņas līgumu	“BOND” – obligācija “BNDF” – regulētā tirgū tirgoti obligāciju nākotnes līgumi “INTR” – procentu likme “IFUT” – regulētā tirgū tirgoti procentu likmes nākotnes līgumi-FRA “FFMC” – MAINĪGO PROCENTU LIKMJU VAIRĀKU VALŪTU MIJMAIŅAS LĪGUMI “XFMC” – FIKSĒTĀS UN MAINĪGĀS PROCENTU LIKMES VAIRĀKU VALŪTU MIJMAIŅAS LĪGUMI “XXSC” – FIKSĒTO PROCENTU LIKMJU VAIRĀKU VALŪTU MIJMAIŅAS LĪGUMI “OSMC” – UZ NAKTI IZSNIEGTO KREDĪTU INDEKSA VAIRĀKU VALŪTU MIJMAIŅAS LĪGUMI “IFMC” – INFLĀCIJAI PIESAISTĪTI VAIRĀKU VALŪTU MIJMAIŅAS LĪGUMI “FFSC” – MAINĪGO PROCENTU LIKMJU VIENAS VALŪTAS MIJMAIŅAS LĪGUMI “XFSC” – FIKSĒTĀS UN MAINĪGĀS PROCENTU LIKMES VIENAS VALŪTAS MIJMAIŅAS LĪGUMI “XXSC” – FIKSĒTO PROCENTU LIKMJU VIENAS VALŪTAS MIJMAIŅAS LĪGUMI “OSSC” – UZ NAKTI IZSNIEGTO KREDĪTU INDEKSA VIENAS VALŪTAS MIJMAIŅAS LĪGUMI “IFSC” – INFLĀCIJAI PIESAISTĪTI VIENAS VALŪTAS MIJMAIŅAS LĪGUMI
17	Pamatā esošās obligācijas emitents	Jāaizpilda, ja pamatā esošā instrumenta veids ir obligācija vai regulētā tirgū tirgots nākotnes līgums par obligāciju, norādot tiešās vai galīgās pamatā esošās obligācijas emitenta juridiskās personas identifikatora kodu (LEI).	{LEI}

#	LAUKS	SNIEDZAMĀS ZIŅAS	ZIŅOJUMU IESNIEGŠANAS FORMĀTS
18	Pamatā esošās obligācijas termiņš	Jāaizpilda ar pamatā esošās obligācijas termiņa datumu Lauks attiecas uz parāda instrumentiem ar noteiktu termiņu.	{DATEFORMAT}
19	Pamatā esošās obligācijas emisijas datums	Jāaizpilda ar pamatā esošās obligācijas emisijas datumu	{DATEFORMAT}
20	Mijmaiņas iespējas līguma nosacītā valūta	Jāaizpilda attiecībā uz mijmaiņas iespējas līgumiem.	{CURRENCYCODE_3}
21	Pamatā esošā mijmaiņas līguma termiņš	Aizpildāms tikai attiecībā uz mijmaiņas iespējas līgumiem, regulētā tirgū tirgotiem nākotnes līgumiem par mijmaiņas līgumiem un regulētā tirgū netirgotiem nākotnes līgumiem par mijmaiņas līgumu.	{DATEFORMAT}
22	Inflācijas indeksa ISIN kods	Mijmaiņas iespējas līgumi par vienu no turpmāk minētajiem pamatā esošajiem mijmaiņas līgumu veidiem: inflācijai piesaistīts vienas valūtas mijmaiņas līgums, regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par inflācijai piesaistītu vienas valūtas mijmaiņas līgumu, inflācijai piesaistīts vairāku valūtu mijmaiņas līgums, regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par vairāku valūtu mijmaiņas līgumu. ja inflācijas indeksam ir ISIN, lauks jāaizpilda ar ISIN kodu attiecīgajam indeksam.	{ISIN}
23	Inflācijas indeksa nosaukums	Jāaizpilda ar indeksa standartizētu nosaukumu attiecībā uz mijmaiņas iespējas līgumiem par vienu no turpmāk minētajiem pamatā esošajiem mijmaiņas līgumu veidiem: inflācijai piesaistīts vienas valūtas mijmaiņas līgums, regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par inflācijai piesaistītu vienas valūtas mijmaiņas līgumu, inflācijai piesaistīts vairāku valūtu mijmaiņas līgums, regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi/regulētā tirgū netirgoti nākotnes līgumi par vairāku valūtu mijmaiņas līgumu.	{ALPHANUM-25}
24	Atsauces likme	Atsauces likmes nosaukums.	{INDEX} vai {ALPHANUM-25} – ja atsauces likme nav iekļauta {INDEX} sarakstā
25	PL līguma termiņš	Šajā laukā ir noteikts līguma termiņš. Termiņu izsaka dienās, nedēļās, mēnešos vai gados.	INTEGER-3+“DAYS” – dienas INTEGER-3+“WEEK” – nedēļas INTEGER-3+“MNTH” – mēneši INTEGER-3+“YEAR” – gadi

Ārvalstu valūtas atvasinātie instrumenti

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

26	Līguma paveids	Jāaizpilda, lai nošķirtu piegādājamus un nepiegādājamus regulētā tirgū netirgotus nākotnes līgumus, iespējas līgumus un mijmaiņas līgumus, kā definēts III pielikuma 8. iedaļas 8.1. tabulā.	“DLVR” – piegādājami “NDLV” – nepiegādājami
----	----------------	--	--

#	LAUKS	SNIEDZAMĀS ZIŅAS	ZIŅOJUMU IESNIEGŠANAS FORMĀTS
---	-------	------------------	-------------------------------

Kapitāla vērtspapīru atvasinātie instrumenti

Lauki šajā iedaļā jāaizpilda tikai attiecībā uz kapitāla vērtspapīru atvasinātajiem instrumentiem, kā definēts III pielikuma 6. iedaļas 6.1. tabulā

27	Pamatā esošā instrumenta veids	Jāaizpilda, ja FITR identifikators ir atvasināts instruments, pamatā esošā instrumenta aktīvu klase ir kapitāla vērtspapīrs un aktīvu apakšklase nav ne mijmaiņas līgumi, ne portfeļa mijmaiņas līgumi, lauks ir jāaizpilda, izmantojot kādu no šādiem variantiem: Jāaizpilda, ja FITR identifikators ir atvasināts instruments, pamatā esošā instrumenta aktīvu klase ir kapitāla vērtspapīrs, aktīvu apakšklase ir vai nu mijmaiņas līgumi vai portfeļa mijmaiņas līgumi, un 2. segmentācijas kritērijs, kā definēts III pielikuma 6. iedaļas 6.1. tabulā, ir ar vienu parādnieku saistīts līgums, lauks ir jāaizpilda, izmantojot kādu no šādiem variantiem: Jāaizpilda, ja FITR identifikators ir atvasināts instruments, pamatā esošā instrumenta aktīvu klase ir kapitāla vērtspapīrs, aktīvu apakšklase ir vai nu mijmaiņas līgumi vai portfeļa mijmaiņas līgumi un 2. segmentācijas kritērijs, kā definēts III pielikuma 6. iedaļas 6.1. tabulā, ir indekss, lauks ir jāaizpilda, izmantojot kādu no šādiem variantiem: Jāaizpilda, ja FITR identifikators ir atvasināts instruments, pamatā esošā instrumenta aktīvu klase ir kapitāla vērtspapīrs, aktīvu apakšklase ir vai nu mijmaiņas līgumi vai portfeļa mijmaiņas līgumi un 2. segmentācijas kritērijs, kā definēts III pielikuma 6. iedaļas 6.1. tabulā, ir grozs, lauks ir jāaizpilda, izmantojot kādu no šādiem variantiem:	“STIX” – Akciju indekss “SHRS” – Daļa/akcija “VOLI” – Dividenžu indekss “DVSE” – Akciju dividende “BSKT” – Sabiedrības kapitālpasākumu rezultātā izveidots akciju grozs “ETFS” = biržā tirgoti fondi “VOLI” – Svārstīguma indekss “OTHR” – Citi (tostarp depozitārie sertifikāti, sertifikāti un citi kapitāla vērtspapīru finanšu instrumentiem līdzīgi finanšu instrumenti) “SHRS” – Daļa/akcija “DVSE” – Akciju dividende “ETFS” = biržā tirgoti fondi “OTHR” – Citi (tostarp depozitārie sertifikāti, sertifikāti un citi kapitāla vērtspapīru finanšu instrumentiem līdzīgi finanšu instrumenti) “VOLI” – Akciju indekss “VOLI” – Dividenžu indekss “VOLI” – Svārstīguma indekss “OTHR” – cits “BSKT” – Grozs
28	Parametrs	Jāaizpilda, ja FITR identifikators ir atvasināts instruments, pamatā esošā instrumenta aktīvu klase ir kapitāla vērtspapīrs un aktīvu apakšklase ir viena no šādiem variantiem: mijmaiņas līgumi, portfeļa mijmaiņas līgumi.	“PRBP” – cenas ieņēmumu darbības bāzes parametrs “PRDV” – ieņēmumu no dividendēm parametrs “PRVA” – ieņēmumu dispersijas parametrs “PRVO” – ieņēmumu svārstīguma parametrs

Līgumi par cenu starpībām

Lauki ir jāaizpilda tikai tad, ja līguma veids ir līdzvērtīgs līgumam par cenu starpībām vai starpību derībām

29	Pamatā esošā aktīva veids	Jāaizpilda, ja FITR identifikators ir atvasinātais instruments un līguma veids ir līdzvērtīgs līgumam par cenu starpībām vai starpību derībām	“CURR” – valūta “EQU” – kapitāla vērtspapīrs
----	---------------------------	---	--

#	LAUKS	SNIEDZAMĀS ZIŅAS	ZIŅOJUMU IESNIEGŠANAS FORMĀTS
			"BOND" – obligācijas "FTEQ" – regulētā tirgū tirgoti nākotnes līgumi par kapitāla vērtspapīru "OPEQ" – iespējas līgumi par kapitāla vērtspapīru "COMM" – prece "EMAL" – emisijas kvotas "OTHR" – cits
30	Nosacītā 1. valūta	Pamatā esošo valūtu pāra 1. valūta. Lauku izmanto, ja pamatā esošais instruments ir valūta.	{CURRENCYCODE_3}
31	Nosacītā 2. valūta	Lauku izmanto, ja pamatā esošais instruments ir valūta.	{CURRENCYCODE_3}

Kredītu atvasinātie instrumenti

32	Pamatā esošā kredītriska mijmaiņas darījuma <i>ISIN</i> kods	Jāaizpilda attiecībā uz kredītriska mijmaiņas darījuma atvasinātajiem instrumentiem, kam ir pamatā esošā mijmaiņas darījuma <i>ISIN</i> kods.	{ISIN}
33	Pamatā esošā indeksa kods	Jāaizpilda attiecībā uz indeksa kredītriska mijmaiņas darījumu, kam ir indeksa <i>ISIN</i> kods.	{ISIN}
34	Pamatā esošā indeksa nosaukums	Jāaizpilda attiecībā uz indeksa kredītriska mijmaiņas darījumu atvasinātajiem instrumentiem, izmantojot standartizētu indeksa nosaukumu.	{ALPHANUM-25}
35	Sērija	Indeksa satura sērijas numurs, ja piemērojams. Jāaizpilda par kredītriska mijmaiņas darījumu indeksu vai kredītriska mijmaiņas darījumu indeksa atvasināto instrumentu ar kredītriska mijmaiņas darījumu indeksa sērijām.	{DECIMAL-18/17}
36	Versija	Jaunu sēriju versiju emitē, ja notiek viena instrumenta saistību neizpilde un indekss ir atkārtoti jāsver, lai noteiktu indeksā esošo kopējo instrumentu jauno skaitu. Jāaizpilda par kredītriska mijmaiņas darījumu indeksu vai kredītriska mijmaiņas darījumu indeksa atvasināto instrumentu ar kredītriska mijmaiņas darījumu indeksa attiecīgo versiju.	{DECIMAL-18/17}
37	Pagarinājuma mēneši	Visi mēneši, kuros ir plānots pagarinājums, kā to ir noteicis indeksa sniedzējs konkrētajam gadam. Lauks ir jāatkārto katram pagarinātajam mēnesim. Jāaizpilda par kredītriska mijmaiņas darījumu indeksu vai kredītriska mijmaiņas darījumu indeksa atvasināto instrumentu.	"01", "02", "03", "04", "05", "06", "07", "08", "09", "10", "11", "12"
38	Nākamais pagarinājuma datums	Jāaizpilda par kredītriska mijmaiņas darījumu indeksu vai kredītriska mijmaiņas darījumu indeksa atvasināto instrumentu ar indeksa nākamo pagarinājuma datumu, kā noteicis indeksa sniedzējs.	{DATEFORMAT}

#	LAUKS	SNIEDZAMĀS ZIŅAS	ZIŅOJUMU IESNIEGŠANAS FORMĀTS
39	Valsts un publiskā sektora emitents	Jāaizpilda, ja ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas līguma atsauces struktūra vai ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas līguma atvasinātā instrumenta atsauces struktūra ir valsts emitents, kā definēts III pielikuma 9. iedaļas 9.1. tabulā.	"TRUE" – atsauces struktūra ir valsts un publiskā sektora emitents "FALSE" – atsauces struktūra nav valsts un publiskā sektora emitents
40	Atsauces pienākums	Jāaizpilda par ar vienu parādnieku saistīta kredītriska mijmaiņas darījuma atvasināto instrumentu ar atsauces pienākuma <i>ISIN</i> kodu.	{ISIN}
41	Atsauces vienība	Jāaizpilda, norādot ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas līguma vai ar vienu parādnieku saistītā kredītriska mijmaiņas līguma atvasinātā instrumenta atsauces struktūru.	{COUNTRYCODE_2} vai ISO 3166-2 – 2 zīmju valsts kods, kam seko defise "-" un līdz pat 3 burtciparu zīmju valsts iedalījuma kods vai {LEI}
42	Nosacītā valūta	Valūta, kurā ir denominēta teorētiskā pamatsumma.	{CURRENCYCODE_3}

Emisiju kvotu atvasinātie instrumenti

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

43	Emisijas kvotu atvasināto instrumentu paveids	Jāaizpilda, ja mainīgais #3 "FTR identifikators" ir "DERV"-atvasinātais instruments un mainīgais #4 "pamatā esošā instrumenta aktīvu klase" ir "EMAL"-emisijas kvotas.	"CERE" – sertificētas emisijas samazināšanas vienība "ERUE" – emisijas samazināšanas vienība "EUAE" – Eiropas Savienības emisijas kvota "EUAA" – aviācijas nozares kvota "OTHR" – cits
----	---	--	--