



Obsah

II Nelegislativní akty

NAŘÍZENÍ

- ★ Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2023/944 ze dne 17. ledna 2023, kterým se mění a opravují regulační technické normy stanovené nařízením v přenesené pravomoci (EU) 2017/587, pokud jde o některé požadavky na transparentnost vztahující se na obchody s kapitálovými nástroji ⁽¹⁾ 1
- ★ Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2023/945 ze dne 17. ledna 2023, kterým se mění regulační technické normy stanovené nařízením v přenesené pravomoci (EU) 2017/583, pokud jde o některé požadavky na transparentnost vztahující se na obchody s nekapitálovými nástroji ⁽¹⁾ 17

⁽¹⁾ Text s významem pro EHP.

II

(Nelegislativní akty)

NAŘÍZENÍ

NAŘÍZENÍ KOMISE V PŘENESENÉ PRAVOMOCI (EU) 2023/944

ze dne 17. ledna 2023,

kterým se mění a opravují regulační technické normy stanovené nařízením v přenesené pravomoci (EU) 2017/587, pokud jde o některé požadavky na transparentnost vztahující se na obchody s kapitálovými nástroji

(Text s významem pro EHP)

EVROPSKÁ KOMISE,

s ohledem na Smlouvu o fungování Evropské unie,

s ohledem na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014 ze dne 15. května 2014 o trzích finančních nástrojů a o změně nařízení (EU) č. 648/2012⁽¹⁾, a zejména na čl. 4 odst. 6 třetí pododstavec, čl. 7 odst. 2 třetí pododstavec, čl. 14 odst. 7 třetí pododstavec, čl. 20 odst. 3 třetí pododstavec, čl. 22 odst. 3 druhý pododstavec a čl. 23 odst. 3 třetí pododstavec uvedeného nařízení,

vzhledem k těmto důvodům:

- (1) S přihlédnutím ke zkušenostem získaným při uplatňování nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/587⁽²⁾, zjištění nejednotného uplatňování ustanovení, která se opírají o to, zda obchod je, či není obchodem, při němž se netvoří cena, a s ohledem na změny v postupech obchodování v důsledku technologického rozvoje a přírůpků chování účastníků trhu, které umožňuje zveřejňovat informace s kratším zpožděním, je nutné změnit některá ustanovení uvedeného nařízení v přenesené pravomoci.
- (2) Pojem obchodů, při nichž se netvoří ceny, jenž je relevantní pro použití sjednané obchodní výjimky, povinnosti obchodování s akciemi, jakož i výjimky z požadavků na poobchodní transparentnost pro dvoustranné obchody, si subjekty, na které se vztahuje dohled, vykládaly odlišně, což vedlo k nejednotnému zveřejňování informací poobchodní transparentnosti. Pro zlepšení transparentnosti, kvality údajů a v konečném důsledku pro usnadnění agregace údajů je nutné zjednodušit a vyjasnit režim pro hlášení údajů, jenž se vztahuje na kapitálové obchody. Aby se zamezilo rozdílnému výkladu, měla by být uvedena do souladu různá ustanovení, která se opírají o pojem obchodů, při nichž se netvoří ceny, obsažená jak v nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/587, tak v nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590⁽³⁾, které se týká hlášení obchodů příslušným orgánům. Nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 obsahuje všechny obchody, které mají být vyloučeny z povinnosti hlášení údajů, a proto by jednotlivé obchody obsažené v nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/587 měly být odstraněny.

⁽¹⁾ Úř. věst. L 173, 12.6.2014, s. 84.

⁽²⁾ Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/587 ze dne 14. července 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014 o trzích finančních nástrojů, pokud jde o regulační technické normy týkající se požadavků na transparentnost pro obchodní systémy a investiční podniky v souvislosti s akciemi, cennými papíry nahrazujícími jiné cenné papíry, fondy obchodovanými v obchodním systému, certifikáty a jinými podobnými finančními nástroji a regulační technické normy týkající se povinnosti provádět obchody s určitými akciemi v obchodním systému nebo prostřednictvím systematického internalizátora (Úř. věst. L 87, 31.3.2017, s. 387).

⁽³⁾ Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 ze dne 28. července 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014, pokud jde o regulační technické normy pro hlášení obchodů příslušným orgánům (Úř. věst. L 87, 31.3.2017, s. 449).

- (3) V důsledku uvedení pojmu obchodů, při nichž se netvoří ceny, do souladu s pojmem obsaženým v nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 je definice „předání obchodu“ nebo „převzetí obchodu“ nadbytečná, protože tato definice byla použita pouze v ustanoveních týkajících se uvedeného pojmu. Kromě toho se v uvedeném nařízení v přenesené pravomoci nepoužívá definice „obchodu zajišťujícího financování“. Tyto definice by proto měly být zrušeny.
- (4) Přestože se předobchodní transparentnost u kapitálových nástrojů a nástrojů kapitálového typu díky uplatňování nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/587 zvýšila, úroveň předobchodní transparentnosti v reálném čase u fondů obchodovaných v obchodním systému je nadále nízká. Může za to vysoké procento obchodů s fondy obchodovanými v obchodním systému, a to jak z hlediska počtu obchodů, tak z hlediska obchodovaného objemu, na které se v současnosti vztahuje výjimka, zejména výjimka z důvodu velkého rozsahu stanovená v čl. 4 odst. 1 písm. c) nařízení (EU) č. 600/2014. Cíle uvedeného nařízení, kterým je zvýšení transparentnosti na trhu s fondy obchodovanými v obchodním systému, proto nebylo plně dosaženo. Pro zvýšení předobchodní transparentnosti v reálném čase u fondů obchodovaných v obchodním systému je proto nutné zvýšit prahovou hodnotu předobchodní transparentnosti z důvodu velkého rozsahu, která je platná pro fondy obchodované v obchodním systému. Zvýšení prahové hodnoty zajistí, že se požadavky na předobchodní transparentnost v reálném čase budou vztahovat na více obchodů s fondy obchodovanými v obchodním systému, a zároveň zajistí dostatečnou ochranu před cenovým dopadem u pokynů velkého rozsahu.
- (5) Obdobně je u fondů obchodovaných v obchodním systému nadále nízká i úroveň poobchodní transparentnosti, přičemž podíl odkladů uveřejnění obchodů u fondů obchodovaných v obchodním systému je i nadále výrazně vyšší než u akcií a jiných kapitálových nástrojů. Aby bylo zajištěno, že se požadavky na poobchodní transparentnost v reálném čase budou vztahovat na více obchodů s fondy obchodovanými v obchodním systému, je nutné zvýšit minimální požadovaný objem obchodů s fondy obchodovanými v obchodním systému, které mají nárok na odklad v délce 60 minut. Toto zvýšení prahové hodnoty odráží správnou rovnováhu mezi zvýšením transparentnosti v reálném čase a zajištěním dostatečné ochrany před potenciálními negativními důsledky zobrazování pokynů velkého rozsahu.
- (6) Požadavky na předobchodní transparentnost pro hybridní systémy obchodování si účastníci trhu vykládají odlišně, což má za následek, že provozovatelé těchto systémů uveřejňují informace předobchodní transparentnosti nejednotným způsobem. Hybridní systémy jsou systémy, které kombinují dva nebo více systémů obchodování. Aby se zajistilo, že tito provozovatelé budou uveřejňovat příslušné informace předobchodní transparentnosti v celé Unii jednotným způsobem, měly by být pro hybridní systémy obchodování zavedeny takové požadavky na předobchodní transparentnost, které zajistí, že požadavky na předobchodní transparentnost budou v souladu s požadavky jednotlivých systémů, z nichž se hybridní systém skládá.
- (7) Technologický a tržní vývoj, jako je hojnější používání systémů s kratší čekací dobou, umožňuje účastníkům trhu poskytovat informace o obchodech dříve. S ohledem na to je možnost uveřejňovat poobchodní informace, u kterých byl povolen odklad, nejpozději do poledne následujícího obchodního dne u obchodů provedených méně než dvě hodiny před koncem obchodního dne neúměrně dlouhá. Pro zajištění včasného uveřejnění poobchodních informací je proto nutné zkrátit tuto lhůtu nejpozději do devíti hodin místního času následujícího obchodního dne.
- (8) Obchodní systémy, schválené systémy pro uveřejňování informací a investiční podniky nevykládají požadavky týkající se poskytování informací poobchodní transparentnosti veřejnosti a informací, které mají být poskytnuty Evropskému orgánu pro cenné papíry a trhy (ESMA) a příslušným orgánům pro účely výpočtů transparentnosti, jednotným způsobem. V důsledku toho jsou tyto informace neúplné, nepřesné nebo nejednotné. Tím je omezena použitelnost těchto informací a kvalita a přesnost výpočtů transparentnosti na základě předložených údajů. Na podporu jednotného uplatňování požadavků na poobchodní transparentnost v celé Unii je proto nutné dále upřesnit obsah žádostí o poskytnutí údajů, a zejména podrobné údaje, které mají obchodní systémy, schválené systémy pro uveřejňování informací a poskytovatelé služby konsolidovaných obchodních informací uveřejnit, když hlásí referenční údaje a kvantitativní údaje orgánu ESMA a příslušným orgánům.
- (9) Nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/587 by proto mělo být odpovídajícím způsobem změněno.

- (10) Aby obchodní systémy, schválené systémy pro uveřejňování informací a investiční podniky mohly zavést požadované změny do svých systémů, měly by se některé změny zavedené tímto nařízením použít od 1. ledna 2024. Aby byla zajištěna právní jistota a kontinuita pro obchody provedené před 1. lednem 2024, které jsou však po tomto datu uveřejněny nebo změněny, měly by se na tyto obchody nadále používat články 2, 6 a 13 a příloha I nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/587 ve znění platném ke dni 31. prosince 2023.
- (11) Toto nařízení vychází z návrhů regulačních technických norem předložených Komisi orgánem ESMA.
- (12) Orgán ESMA uskutečnil otevřené veřejné konzultace o návrzích regulačních technických norem, z nichž toto nařízení vychází, analyzoval potenciální související náklady a přínosy a požádal o stanovisko skupinu subjektů působících v oblasti cenných papírů a trhů zřízenou podle článku 37 nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 1095/2010 (*).

PŘIJALA TOTO NAŘÍZENÍ:

Článek 1

Změny nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/587

Nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/587 se mění takto:

- 1) V článku 1 se zrušují body 2 a 3;
- 2) článek 2 se mění takto:
 - a) písmena d) až i) se zrušují;
 - b) doplňuje se nové písmeno j), které zní:

„j) obchod nepředstavuje obchod pro účely článku 26 nařízení (EU) č. 600/2014 v souladu s čl. 2 odst. 5 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 (*).
- 3) článek 6 se mění takto:
 - a) písmena d) až i) se zrušují;
 - b) doplňuje se nové písmeno k), které zní:

„k) obchod nepředstavuje obchod pro účely článku 26 nařízení (EU) č. 600/2014 v souladu s čl. 2 odst. 5 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590.“;
- 4) v článku 7 se odstavec 2 nahrazuje tímto:

„2. Ve vztahu k fondu obchodovanému v obchodním systému je pokyn považován za pokyn velkého rozsahu, pokud je roven částce 3 000 000 EUR nebo vyšší.“;
- 5) v článku 13 se zrušují písmena b), c) a d);
- 6) v čl. 15 odst. 3 se písmeno b) nahrazuje tímto:

„b) pro obchody, na které se nevztahuje písmeno a), nejpozději při zahájení následujícího obchodního dne na nejrelevantnějším trhu z hlediska likvidity.“;

(*) Nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 1095/2010 ze dne 24. listopadu 2010 o zřízení Evropského orgánu dohledu (Evropského orgánu pro cenné papíry a trhy), o změně rozhodnutí č. 716/2009/ES a o zrušení rozhodnutí Komise 2009/77/ES (Úř. věst. L 331, 15.12.2010, s. 84).

7) článek 17 se mění takto:

a) odstavec 2 se nahrazuje tímto:

„2. Příslušné orgány, organizátoři trhu a investiční podniky včetně investičních podniků provozujících obchodní systém použijí informace uveřejněné v souladu s odstavcem 1 tohoto článku pro účely čl. 4 odst. 1 písm. a) a c) a čl. 14 odst. 2 a 4 nařízení (EU) č. 600/2014 po dobu od prvního pondělí dubna roku, ve kterém jsou tyto informace uveřejněny, do dne předcházejícího prvnímu pondělí dubna následujícího roku.“;

b) doplňují se nové odstavce 6 a 7, které znějí:

„6. Pokud orgán ESMA nebo příslušné orgány požadují informace v souladu s článkem 22 nařízení (EU) č. 600/2014, obchodní systémy, schválené systémy pro uveřejňování informací a poskytovatelé konsolidovaných obchodních informací poskytnou tyto informace v souladu s přílohou IV tohoto nařízení.

7. Je-li objem obchodu určený pro účely čl. 7 odst. 1 a 2, čl. 8 odst. 2 písm. a), čl. 11 odst. 1 a čl. 15 odst. 1 vyjádřen v peněžní hodnotě a finanční nástroj není denominován v eurech, objem obchodu se převede na měnu, ve které je tento finanční nástroj denominován, a to s použitím referenčního směnného kurzu eura Evropské centrální banky platného k 31. prosinci předcházejícího roku.“;

8) příloha I se mění v souladu s přílohou I tohoto nařízení;

9) příloha II se mění v souladu s přílohou II tohoto nařízení;

10) znění v příloze III tohoto nařízení se přikládá jako příloha IV.

Článek 2

Opravy nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/587

Nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/587 se opravuje takto:

1) V článku 9 se písmeno b) nahrazuje tímto:

„b) opatření je v souladu s technickými opatřeními odpovídajícími těm, která jsou stanovena pro schválené systémy pro uveřejňování informací v článku 14 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/571, které umožňují konsolidaci těchto údajů s podobnými údaji z jiných zdrojů;“

2) článek 18 se nahrazuje tímto:

„Článek 18

Odkaz na příslušné orgány

(čl. 22 odst. 1 nařízení (EU) č. 600/2014)

Příslušným orgánem pro určitý finanční nástroj odpovědným za provádění výpočtů a zajištění uveřejnění informací uvedených v člancích 4, 7, 11 a 17 je příslušný orgán nejrelevantnějšího trhu z hlediska likvidity uvedený v článku 26 nařízení (EU) č. 600/2014 a blíže upřesněný v článku 16 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590.“

Článek 3

Přechodná ustanovení

Články 2, 6 a 13 a příloha I nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/587 ve znění platném ke dni 31. prosince 2023 se nadále použijí na obchody provedené před 1. lednem 2024.

*Článek 4***Vstup v platnost a použitelnost**

Toto nařízení vstupuje v platnost dvacátým dnem po vyhlášení v *Úředním věstníku Evropské unie*.

Ustanovení čl. 1 bodů 2, 3, 5 a 8 se použijí od 1. ledna 2024.

Toto nařízení je závazné v celém rozsahu a přímo použitelné ve všech členských státech.

V Bruselu dne 17. ledna 2023.

Za Komisi
předsedkyně
Ursula VON DER LEYEN

PŘÍLOHA I

Příloha I nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/587 se mění takto:

1) Tabulka 1 se nahrazuje tímto:

„Tabulka 1

Popis druhů systémů obchodování a související informace, které mají být uveřejněny v souladu s článkem 3

Řádek	Druh systému obchodování	Popis systému obchodování	Informace, které mají být uveřejněny
1	Systém obchodování formou průběžné aukce na základě knihy objednávek	Systém, který na základě knihy objednávek a obchodního algoritmu průběžně bez lidského zásahu páruje pokyny k prodeji s pokyny ke koupi podle nejlepší dostupné ceny.	Celkový počet pokynů a akcií, cenných papírů nahrazujících jiné cenné papíry, fondů obchodovaných v obchodním systému, certifikátů a jiných podobných finančních nástrojů, které tyto pokyny reprezentují, v každé cenové hladině, a to nejméně pro pět nejlepších cenových hladin nabídek na nákup a prodej.
2	Systém obchodování řízený kotacemi	Systém, při němž se obchody uzavírají na základě pevných kotací, jež mají účastníci průběžně k dispozici, a který vyžaduje, aby tvůrci trhu udržovali kotace v objemu, jenž zachovává rovnováhu mezi potřebami členů a účastníků obchodovat v komerčních objemech a rizikem, jemuž se vystavuje sám tvůrce trhu.	Nejlepší cenová nabídka každého tvůrce trhu na nákup a prodej akcií, cenných papírů nahrazujících jiné cenné papíry, fondů obchodovaných v obchodním systému, certifikátů a jiných podobných finančních nástrojů obchodovaných v obchodním systému spolu s objemy, jež se váží k těmto nabídkám. Uveřejněné kotace představují závazky k nákupu a prodeji finančních nástrojů a uvádějí cenu a objem finančních nástrojů, za něž jsou registrovaní tvůrci trhu připraveni je koupit nebo prodat. Za výjimečných tržních podmínek však lze po omezenou dobu povolit orientační nebo jednostranné kotace.
3	Systém obchodování formou periodických aukcí	Systém, který páruje pokyny na základě periodické aukce a obchodního algoritmu provozovaného bez lidského zásahu.	Cena akcií, cenných papírů nahrazujících jiné cenné papíry, fondů obchodovaných v obchodním systému, certifikátů a jiných podobných finančních nástrojů obchodovaných v obchodním systému, jež by byla nejvíce v souladu s obchodním algoritmem tohoto systému obchodování formou aukce, a objem, který by potenciálně byl za tuto cenu v daném systému zobchodovatelný.

Řádek	Druh systému obchodování	Popis systému obchodování	Informace, které mají být uveřejněny
4	Systém obchodování formou žádostí o kotace	Systém, ve kterém se kotace poskytuje nebo poskytují na základě žádosti jednoho či více členů nebo účastníků. Tato kotace je zobchodovatelná pouze žádajícím členem nebo účastníkem. Žádající člen nebo účastník může uzavřít obchod přijetím kotace nebo kotací, jež mu byly na jeho žádost poskytnuty.	Kotace a k nim se vážící objemy libovolného člena nebo účastníka, jejichž přijetí by vedlo k uzavření obchodu podle pravidel systému. Všechny kotace předložené na žádost o kotaci mohou být uveřejněny současně, ale nejpozději do té doby, než se stanou zobchodovatelnými.
5	Hybridní systém obchodování	Systém spadající do dvou nebo více druhů systémů obchodování uvedených v řádcích 1 až 4 této tabulky.	U hybridních systémů, které kombinují různé systémy obchodování současně, požadavky odpovídají požadavkům na předobchodní transparentnost platným pro každý druh systému obchodování, který tvoří hybridní systém. U hybridních systémů, které kombinují dva nebo více systémů obchodování po sobě, požadavky odpovídají požadavkům na předobchodní transparentnost platným pro příslušný systém obchodování, který je v daném okamžiku provozovaný.
6	Všechny ostatní systémy obchodování	Jakýkoliv jiný druh systému obchodování neuvedený v řádcích 1 až 5.	Odpovídající informace o úrovni pokynů či kotací a obchodních zájmů, pokud jde o akcie, cenné papíry nahrazující jiné cenné papíry, fondy obchodované v obchodním systému, certifikáty a jiné podobné finanční nástroje obchodované v obchodním systému; zejména pět nejlepších nabídkových a poptávkových cen nebo dvousměrných kotací každého tvůrce trhu s daným finančním nástrojem, pokud to umožňují parametry mechanismu určování cen.“

2) Tabulky 3 a 4 se nahrazují tímto:

„Tabulka 3

Seznam údajů pro účely poobchodní transparentnosti

Č.	Identifikátor pole	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 2
1	Datum a čas obchodování	Datum a čas provedení obchodu. V případě obchodů provedených v obchodním systému musí být míra podrobnosti v souladu s požadavky stanovenými v článku 2 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/574. V případě obchodů, které nejsou provedeny v obchodním systému, datum a čas dohody stran na obsahu těchto polí: množství, cena, měny, jak jsou stanoveny v polích 31, 34 a 44 v tabulce 2 přílohy I nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, identifikační kód	Regulovaný trh (RM) Mnohostranný obchodní systém (MTF) Schválený systém pro uveřejňování informací (APA) Poskytovatel konsolidovaných obchodních informací (CTP)	{DATE_TIME_FORMAT}

Č.	Identifikátor pole	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 2
		<p>nástroje, klasifikace nástroje a popřípadě kód podkladového nástroje. V případě obchodů, které nejsou provedeny v obchodním systému, se čas uvádí s přesností alespoň na nejbližší sekundu.</p> <p>Pokud je obchod výsledkem pokynu předaného provádějícím podnikem jménem zákazníka třetí straně a pokud nebyly splněny podmínky předání stanovené v článku 4 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, uvádí se datum a čas provedení obchodu, nikoli čas předání pokynu.</p>		
2	Identifikační nástroje	kód Kód sloužící k identifikaci finančního nástroje.	RM, MTF, APA, CTP	{ISIN}
3	Cena	<p>Obchodovaná cena bez případné provize a vzniklého úroku.</p> <p>Pokud se cena oznamuje v peněžní hodnotě, uvádí se v hlavní měnové jednotce.</p> <p>Pokud cena není v současnosti k dispozici, ale bude uveřejněna („PNDG“), nebo pokud není relevantní („NOAP“), pole se nevyplňuje.</p>	RM, MTF, APA, CTP	<p>{DECIMAL-18/13}, pokud je cena vyjádřena peněžní hodnotou v případě kapitálových nástrojů a finančních nástrojů kapitálového typu</p> <p>{DECIMAL-11/10}, pokud je cena vyjádřena procentním podílem nebo výnosem v případě certifikátů a jiných finančních nástrojů kapitálového typu</p>
4	Chybějící cena	<p>Pokud cena není právě k dispozici, ale čeká se na její určení, hodnota bude „PNDG“.</p> <p>Je-li cena irelevantní, hodnota bude „NOAP“.</p>	RM, MTF, APA, CTP	<p>„PNDG“, pokud cena není k dispozici</p> <p>„NOAP“ pokud cena není relevantní</p>
5	Měna ceny	Jednotka hlavní měny, v níž je cena vyjádřena (v případě, že je cena vyjádřena peněžní hodnotou).	RM, MTF, APA, CTP	{CURRENCYCODE_3}
6	Cenová notace	Údaj o tom, zda je cena vyjádřena jako peněžní hodnota, procentní podíl nebo výnos.	RM, MTF, APA, CTP	<p>„MONE“ – peněžní hodnota</p> <p>v případě kapitálových nástrojů a finančních nástrojů kapitálového typu</p> <p>„PERC“ – procentní podíl</p>

Č.	Identifikátor pole	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 2
				<p>v případě certifikátů a jiných finančních nástrojů kapitálového typu</p> <p>„YIEL“ – výnos</p> <p>v případě certifikátů a jiných finančních nástrojů kapitálového typu</p> <p>„BAPO“ – bazické body</p> <p>v případě certifikátů a jiných finančních nástrojů kapitálového typu</p>
7	Množství	<p>Počet jednotek finančních nástrojů.</p> <p>Nominální nebo peněžní hodnota finančního nástroje.</p>	RM, MTF, APA, CTP	<p>{DECIMAL-18/17} v případě, že je množství vyjádřeno počtem jednotek</p> <p>{DECIMAL-18/5} v případě, že je množství vyjádřeno peněžní nebo nominální hodnotou</p>
8	Převodní místo	<p>Identifikace místa, kde byl obchod proveden.</p> <p>V případě obchodů provedených v obchodním systému EU se použije MIC segmentu podle ISO 10383. Pokud MIC segmentu neexistuje, použije se operační MIC.</p> <p>Pokud je v případě finančních nástrojů přijatých k obchodování nebo obchodovaných v obchodním systému obchod s daným finančním nástrojem proveden prostřednictvím systematického internalizátora, použije se „SINT“.</p> <p>Pokud v případě finančních nástrojů přijatých k obchodování nebo obchodovaných v obchodním systému není obchod s daným finančním nástrojem proveden v obchodním systému EU ani prostřednictvím systematického internalizátora, použije se kód MIC „XOFF“. Pokud je obchod proveden na organizované obchodní platformě mimo EU, je kromě kódu MIC „XOFF“ vyžadováno i vyplnění pole „Obchodní převodní místo třetí země“.</p>	RM, MTF, APA, CTP	<p>{MIC} – obchodní systémy EU nebo</p> <p>„SINT“ – systematický internalizátor</p> <p>„XOFF“ – v jiných případech</p>

Č.	Identifikátor pole	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 2
9	Obchodní převodní místo třetí země	<p>Identifikace převodního místa třetí země, kde byl obchod proveden. Použijte MIC segment podle ISO 10383. Pokud MIC segmentu neexistuje, použijte operační MIC.</p> <p>Pokud obchod není proveden v převodním místě třetí země, pole se nevyplňuje.</p>	APA, CTP	{MIC}
10	Datum a čas uveřejnění	<p>Datum a čas uveřejnění obchodu obchodním systémem nebo APA.</p> <p>V případě obchodů provedených v obchodním systému musí být míra podrobnosti v souladu s požadavky stanovenými v článku 2 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/574.</p> <p>V případě obchodů, které nejsou provedeny v obchodním systému, se datum a čas uvádí s přesností alespoň na nejbližší sekundu.</p>	RM, MTF, APA, CTP	{DATE_TIME_FORMAT}
11	Místo uveřejnění	Kód sloužící k identifikaci obchodního systému nebo APA uveřejňujícího obchod.	CTP	<p>Obchodní systém: {MIC}</p> <p>APA: MIC segmentu podle ISO 10383 (4 znaky), pokud je k dispozici. V opačném případě čtyřmístný kód uveřejněný v seznamu poskytovatelů služeb hlášení údajů na internetových stránkách orgánu ESMA.</p>
12	Identifikační kód obchodu	<p>Alfanumerický kód přidělený danému obchodu obchodním systémem (v souladu s článkem 12 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580 (!)) a schváleným systémem pro uveřejňování informací (APA), který se používá při každém dalším odkazu na daný obchod.</p> <p>Identifikační kód obchodu musí být jedinečný, konzistentní a trvalý pro každý MIC segmentu podle ISO10383 a obchodní den. Pokud obchodní systém nepoužívá MIC segmentu, identifikační kód obchodu musí být jedinečný, konzistentní a trvalý pro daný operační MIC a daný obchodní den.</p>	RM, MTF, APA, CTP	{ALPHANUM-52}

Č.	Identifikátor pole	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 2
		<p>V případě, že APA nepoužívá kódy MIC, musí být identifikační kód obchodu jedinečný, konzistentní a trvalý pro čtyřmístný kód použitý k identifikaci APA a daný obchodní den.</p> <p>Prvky identifikačního kódu obchodu by neměly prozrazovat totožnost protistran obchodu, k němuž se kód vztahuje.</p>		

(¹) Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580 ze dne 24. června 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014, pokud jde o regulační technické normy pro uchovávání příslušných údajů o pokynech týkajících se finančních nástrojů (Úř. věst. L 87, 31.3.2017, s. 193).

Tabulka 4

Seznam označení pro účely poobchodní transparentnosti

Označení	Název	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Popis
„BENC“	Označení referenčního obchodu	RM, MTF APA CTP	Obchod je proveden s odkazem na cenu, která je vypočtena ve více okamžicích na základě dané referenční hodnoty, jako je například průměrná cena vážená objemem nebo průměrná cena vážená časem.
„NPFT“	Označení obchodů, při nichž se netvoří ceny	RM, MTF CTP	Obchody, při nichž se netvoří ceny, podle čl. 2 odst. 5 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590.
„PORT“	Označení portfoliového obchodu	RM, MTF APA CTP	Obchody s pěti nebo více různými finančními nástroji, které jsou obchodovány ve stejnou dobu, stejným zákazníkem a jako jedna položka se specifickou referenční cenou.
„CONT“	Označení podmíněného obchodu	RM, MTF APA CTP	Obchod, který je podmíněný nákupem, prodejem, vytvořením nebo vyplacením derivátové smlouvy nebo jiného finančního nástroje, kde mají být veškeré součásti obchodu provedeny jako jedna položka.
„ACTX“	Označení duálních obchodů	APA CTP	Obchody, ve kterých investiční podnik spároval pokyny zákazníků prostřednictvím nákupu a prodeje provedených jako jeden obchod a zahrnujících stejný objem a cenu.
„SDIV“	Označení obchodů s mimořádnými dividendami	RM, MTF APA CTP	Obchody, jež jsou provedeny buď: v období bez nároku na dividendu, v němž dividendu nebo jiná forma rozdělení zisku připadá kupci místo prodejci; nebo v období s nárokem na dividendu, v němž dividendu nebo jiná forma rozdělení zisku připadá prodejci místo kupci.

Označení	Název	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Popis
„LRGS“	Označení obchodů s poobchodním odkladem z důvodu velkého rozsahu	RM, MTF APA CTP	Obchody, jež jsou velkého rozsahu ve srovnání s obvyklým tržním objemem a u nichž byl povolen odklad uveřejnění podle článku 15.
„RFPT“	Označení obchodů s referenční cenou	RM, MTF CTP	Obchody, jež jsou provedeny v systému provozovaném v souladu s čl. 4 odst. 1 písm. a) nařízení (EU) č. 600/2014.
„NLIQ“	Označení sjednaného obchodu s likvidními finančními nástroji	RM, MTF CTP	Obchody, jež jsou provedeny v souladu s čl. 4 odst. 1 písm. b) bodem i) nařízení (EU) č. 600/2014.
„OILQ“	Označení sjednaného obchodu s nelikvidními finančními nástroji	RM, MTF CTP	Obchody, jež jsou provedeny v souladu s čl. 4 odst. 1 písm. b) bodem ii) nařízení (EU) č. 600/2014.
„PRIC“	Označení sjednaných obchodů podléhajících jiným podmínkám, než je aktuální tržní cena	RM, MTF CTP	Obchody, jež jsou provedeny v souladu s čl. 4 odst. 1 písm. b) bodem iii) nařízení (EU) č. 600/2014 a jak je stanoveno v článku 6.
„ALGO“	Označení algoritmického obchodu	RM, MTF CTP	Obchody provedené prostřednictvím zapojení investičního podniku do algoritmického obchodování, jak je definuje čl. 4 odst. 1 bod 39 směrnice 2014/65/EU.
„SIZE“	Označení obchodů přesahujících standardní tržní objem	APA CTP	Obchody provedené prostřednictvím systematického internalizátora, u nichž objem zadaného pokynu přesahuje standardní tržní objem určený v souladu s článkem 11.
„ILQD“	Označení obchodu s nelikvidními finančními nástroji	APA CTP	Obchody s nelikvidními finančními nástroji určenými v souladu s články 1 až 5 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/567 ⁽¹⁾ provedené prostřednictvím systematického internalizátora.
„RPRI“	Označení obchodů provedených za lepší cenu	APA CTP	Obchody provedené prostřednictvím systematického internalizátora za lepší cenu v souladu s čl. 15 odst. 2 nařízení (EU) č. 600/2014.
„CANC“	Označení zrušeného obchodu	RM, MTF APA CTP	Je-li dříve uveřejněný obchod zrušen
„AMND“	Označení změny	RM, MTF APA CTP	Je-li dříve uveřejněný obchod změněn.
„DUPL“	Označení duplicitních hlášení obchodu	APA	Pokud je obchod hlášen více než jednomu APA v souladu s čl. 16 odst. 1 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/571.

⁽¹⁾ Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/567 ze dne 18. května 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014, pokud jde o definice, transparentnost, kompresi portfolia a dohledová opatření v oblasti zásahů u produktů a pozic (Úř. věst. L 87, 31.3.2017, s. 90).“

PŘÍLOHA II

V příloze II nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/587 se tabulka 5 nahrazuje tímto:

„Tabulka 5

Prahové hodnoty a lhůty pro odklad uveřejnění pro fondy obchodované v obchodním systému

Minimální požadovaný objem obchodu pro povolený odklad uveřejnění v EUR	Lhůta pro uveřejnění po provedení obchodu
15 000 000	60 minut
50 000 000	Konec obchodního dne“

PŘÍLOHA III

„PŘÍLOHA IV

Údaje, které mají být poskytnuty za účelem určení nejrelevantnějšího trhu z hlediska likvidity, průměrného denního obratu (ADT) a průměrné hodnoty obchodů (AVT)

Tabulka 1

Tabulka symbolů

Symbol	Druh údaje	Definice
{ALPHANUM-n}	Až n alfanumerických znaků	Volný text
{ISIN}	12 alfanumerických znaků	Kód ISIN ve smyslu normy ISO 6166
{MIC}	4 alfanumerické znaky	Identifikační kód trhu ve smyslu normy ISO 10383
{DATEFORMAT}	Formát data podle ISO 8601	Formátování dat: RRRR-MM-DD
{DECIMAL-n/m}	Celkem až n-místné desetinné číslo, z čehož až m míst může být zlomková část	Numerické pole pro kladné i záporné hodnoty. desetinný oddělovač je „.“ (tečka), před zápornými čísly je znaménko „-“ (minus); hodnoty se nezkracují, nýbrž zaokrouhlují.
{INTEGER-n}	Až n-místné celé číslo	Numerické pole pro kladné i záporné celé hodnoty.

Tabulka 2

Podrobné údaje, které mají být poskytnuty za účelem určení nejrelevantnějšího trhu z hlediska likvidity, průměrného denního obratu (ADT) a průměrné hodnoty obchodů (AVT) (na základě stávajících pokynů pro hlášení údajů)

Pole č.	Identifikátor pole	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 1
1	Identifikační kód nástroje	Kód sloužící k identifikaci finančního nástroje	Regulovaný trh (RM) Mnohostranný obchodní systém (MTF) Schválený systém pro uveřejňování informací (APA) Poskytovatel konsolidovaných obchodních informací (CTP)	{ISIN}
2	Datum provedení	Datum, kdy jsou obchody provedeny.	RM, MTF, APA, CTP	{DATEFORMAT}

Pole č.	Identifikátor pole	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 1
3	Převodní místo	MIC segmentu pro obchodní systém EU nebo systematický internalizátor, je-li k dispozici, jinak operační MIC. MIC XOFF v případě, že obchod provádějí investiční podniky, které nejsou systematickými internalizátory, a obchod není proveden v obchodním systému.	RM, MTF, APA, CTP	{MIC} – obchodního systému nebo systematického internalizátora nebo {MIC} – XOFF
4	Označení pozastaveného nástroje	Ukazatel toho, zda byl nástroj pozastaven v příslušném obchodním systému v den provedení na celý obchodní den. V důsledku pozastavení nástroje na celý obchodní den se pole 5 až 10 vykazují s hodnotou nula.	RM, MTF, CTP	TRUE – pokud nástroj byl pozastaven na celý obchodní den FALSE – pokud nástroj nebyl pozastaven na celý obchodní den
5	Celkový počet obchodů	Celkový počet obchodů provedených k datu provedení (**).	RM, MTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
6	Celkový obrat	Celkový obrat dosažený k datu provedení, vyjádřený v eurech (*) (**).	RM, MTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}
7	Provedené obchody, s výjimkou všech obchodů provedených na základě předobchodních výjimek podle čl. 4 odst. 1 písm. a), b) a c) nařízení (EU) č. 600/2014.	Celkový počet obchodů provedených k datu provedení s výjimkou všech obchodů provedených na základě předobchodních výjimek podle čl. 4 odst. 1 písm. a), b) a c) nařízení (EU) č. 600/2014 ve stejný den (**).	RM, MTF, CTP	{INTEGER-18}
8	Dosažený celkový obrat, s výjimkou všech obchodů provedených na základě předobchodních výjimek podle čl. 4 odst. 1 písm. a), b) a c) nařízení (EU) č. 600/2014.	Celkový obrat dosažený k datu provedení s výjimkou všech obchodů provedených na základě předobchodních výjimek podle čl. 4 odst. 1 písm. a), b) a c) nařízení (EU) č. 600/2014 ve stejný den (*) (**).	RM, MTF, CTP	{DECIMAL-18/5}

Pole č.	Identifikátor pole	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 1
9	Celkový počet obchodů s výjimkou obchodů provedených v rámci poobchodního odkladu z důvodu velkého rozsahu (LIS).	<p>Celkový počet obchodů provedených k datu provedení s výjimkou obchodů provedených v rámci výjimky z důvodu velkého rozsahu (poobchodní) (**).</p> <p>U akcií a cenných papírů nahrazujících jiné cenné papíry se k identifikaci těchto obchodů použije pouze nejvyšší prahová hodnota pro související rozpětí průměrného denního obratu (ADT) v tabulce 4 přílohy II.</p> <p>U certifikátů a jiných podobných finančních nástrojů se k identifikaci těchto obchodů použije pouze nejvyšší prahová hodnota v tabulce 6 přílohy II.</p> <p>U fondů obchodovaných v obchodním systému se k identifikaci těchto obchodů použije pouze nejvyšší prahová hodnota v tabulce 5 přílohy II.</p>	RM, MTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
10	Celkový dosažený obrat s výjimkou obchodů provedených v rámci poobchodního odkladu z důvodu velkého rozsahu (LIS).	<p>Celkový objem obchodů provedených k datu provedení s výjimkou obchodů provedených v rámci výjimky z důvodu velkého rozsahu (poobchodní) (*) (**).</p> <p>U akcií a cenných papírů nahrazujících jiné cenné papíry se k identifikaci těchto obchodů použije pouze nejvyšší prahová hodnota pro související rozpětí průměrného denního obratu (ADT) v tabulce 4 přílohy II.</p> <p>U certifikátů a jiných podobných finančních nástrojů se k identifikaci těchto obchodů použije pouze nejvyšší prahová hodnota v tabulce 6 přílohy II.</p> <p>U fondů obchodovaných v obchodním systému se k identifikaci těchto obchodů použije pouze nejvyšší prahová hodnota v tabulce 5 přílohy II.</p>	RM, MTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

(*) Obrat se vypočítá jako počet nástrojů vyměněných mezi kupujícími a prodávajícími vynásobený jednotkovou cenou nástroje vyměněného v rámci daného konkrétního obchodu a je vyjádřen v eurech.

(**) Obchody, které byly zrušeny, musí být z hlášených údajů vyloučeny.

Každopádně musí být do pole vyplněna hodnota větší než nula nebo rovna nule, o maximálně 18 číselných znacích včetně až 5 desetinných míst.“

NAŘÍZENÍ KOMISE V PŘENESENÉ PRÁVOMOCI (EU) 2023/945**ze dne 17. ledna 2023,****kterým se mění regulační technické normy stanovené nařízením v přenesené pravomoci (EU) 2017/583, pokud jde o některé požadavky na transparentnost vztahující se na obchody s nekapitálovými nástroji****(Text s významem pro EHP)**

EVROPSKÁ KOMISE,

s ohledem na Smlouvu o fungování Evropské unie,

s ohledem na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014 ze dne 15. května 2014 o trzích finančních nástrojů a o změně nařízení (EU) č. 648/2012 ⁽¹⁾, a zejména na čl. 9 odst. 5 třetí pododstavec, čl. 11 odst. 4 třetí pododstavec, čl. 14 odst. 7 třetí pododstavec, čl. 21 odst. 5 třetí pododstavec a čl. 22 odst. 3 druhý pododstavec uvedeného nařízení,

vzhledem k těmto důvodům:

- (1) S přihlédnutím ke zkušenostem získaným při uplatňování nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/583 ⁽²⁾, zjištění nejednotného uplatňování ustanovení, která se opírají o to, zda obchod je, či není obchodem, při němž se netvoří cena, a s ohledem na změny v postupech obchodování v důsledku technologického rozvoje a přizpůsobení chování účastníků trhu, které umožňuje zveřejňovat informace s kratším zpožděním, je nutné změnit některá ustanovení uvedeného nařízení v přenesené pravomoci.
- (2) Koncepce obchodů, při nichž se netvoří ceny, jež je relevantní pro uplatnění výjimky z požadavků na poobchodní transparentnost u dvoustranných obchodů, byla subjekty, nad nimiž je vykonáván dohled, vykládána různě, což vedlo k nejednotnému uveřejňování informací týkajících se poobchodní transparentnosti v souladu s článkem 21 nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014 ⁽³⁾. Pro zlepšení transparentnosti, kvality údajů a v konečném důsledku pro usnadnění agregace údajů je nezbytné zjednodušit a vyjasnit režim podávání zpráv platný pro nekapitálové obchody. Aby se předešlo rozdílnému výkladu, měla by být sjednocena různá ustanovení, která se opírají o koncepci obchodů, při nichž se netvoří ceny, jak v nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/587 ⁽⁴⁾, tak v nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 ⁽⁵⁾, jež se týká hlášení obchodů příslušným orgánům. Vzhledem k tomu, že seznam obchodů, při nichž se netvoří ceny, v nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 obsahuje všechny obchody, které mají být z oznamovací povinnosti vyloučeny, měly by být jednotlivé obchody v nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/587 odstraněny.
- (3) Požadavky na předobchodní transparentnost pro hybridní systémy obchodování si účastníci trhu vykládají odlišně, což má za následek, že provozovatelé těchto systémů uveřejňují informace předobchodní transparentnosti nejednotným způsobem. Hybridní systémy jsou systémy, které kombinují dva nebo více systémů obchodování. Aby se zajistilo, že tito provozovatelé budou uveřejňovat příslušné informace předobchodní transparentnosti v celé Unii jednotným způsobem, měly by být pro hybridní systémy obchodování zavedeny takové požadavky na předobchodní transparentnost, které zajistí, že požadavky na předobchodní transparentnost budou v souladu s požadavky jednotlivých systémů, z nichž se hybridní systém skládá.

⁽¹⁾ Úř. věst. L 173, 12.6.2014, s. 84.

⁽²⁾ Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/583 ze dne 14. července 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014 o trzích finančních nástrojů, pokud jde o regulační technické normy týkající se požadavků na transparentnost pro obchodní systémy a investiční podniky v souvislosti s dluhopisy, strukturovanými finančními produkty, povolenkami na emise a deriváty (Úř. věst. L 87, 31.3.2017, s. 229).

⁽³⁾ Nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014 ze dne 15. května 2014 o trzích finančních nástrojů a o změně nařízení (EU) č. 648/2012 (Úř. věst. L 173, 12.6.2014, s. 84).

⁽⁴⁾ Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/587 ze dne 14. července 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014 o trzích finančních nástrojů, pokud jde o regulační technické normy týkající se požadavků na transparentnost pro obchodní systémy a investiční podniky v souvislosti s akciemi, cennými papíry nahrazujícími jiné cenné papíry, fondy obchodovanými v obchodním systému, certifikáty a jinými podobnými finančními nástroji a regulační technické normy týkající se povinnosti provádět obchody s určitými akciemi v obchodním systému nebo prostřednictvím systematického internalizátora (Úř. věst. L 87, 31.3.2017, s. 387).

⁽⁵⁾ Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 ze dne 28. července 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014, pokud jde o regulační technické normy pro hlášení obchodů příslušným orgánům (Úř. věst. L 87, 31.3.2017, s. 449).

- (4) Ve veřejných zprávách o obchodech s finančními nástroji byly některé klíčové prvky, například cena, množství a pomyslná částka, vyjádřeny nejednotně. Vyjádření těchto prvků by mělo být v souladu s tržními zvyklostmi v souvislosti s jednotlivými nástroji. Pokud jde o dluhopisy, cena by měla být vyjádřena v procentech, pokud tržní zvyklosti neurčují, že se cena určitého typu dluhopisu vyjadřuje jinak. U swapů úvěrového selhání by měla být cena vyjádřena v bazických bodech, které dostane prodejce zajištění úvěrového rizika.
- (5) Obchody, při nichž je jednomu klientovi, včetně protistran, současně prodáno několik různých dluhopisů nebo jiných finančních nástrojů jako portfoliový obchod za jedinou cenu za celý soubor, nejsou ve veřejných zprávách jako takové rozpoznatelné. Bez přesné identifikace těchto portfoliových obchodů se ve veřejných zprávách zobrazuje několik jednotlivých obchodů za cenu, která neodráží tržní cenu. Proto je nutné doplnit do tabulky 3 přílohy II nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/587 označení pro portfoliové obchody, které by tyto obchody identifikovalo.
- (6) Obchodní systémy, schválené systémy pro uveřejňování informací a investiční podniky nevykládaly požadavky týkající se poskytování informací poobchodní transparentnosti veřejnosti a informací, které mají být poskytovány Evropskému orgánu pro cenné papíry a trhy (ESMA) a příslušným orgánům pro účely výpočtu transparentnosti, jednotným způsobem. V důsledku toho jsou tyto informace neúplné, nepřesné nebo nekonzistentní. Tato skutečnost snižuje použitelnost těchto informací a kvalitu a přesnost výpočtů transparentnosti založených na předložených údajích. S cílem podpořit jednotné uplatňování požadavků na poobchodní transparentnost v celé Unii je nezbytné dále upřesnit, jakým způsobem by měly obchodní systémy, schválené systémy pro uveřejňování informací a investiční podniky uveřejňovat podrobnosti, například cenu a pomyslnou částku, v souvislosti s různými finančními nástroji, a jak vykazovat referenční údaje a kvantitativní údaje orgánu ESMA a příslušným orgánům.
- (7) Likvidita komoditních derivátů se výrazně liší v závislosti na vlastnostech nástrojů. Formát, v němž se vykazují některé charakteristiky komoditních derivátů a derivátů týkajících se sazeb přepravného, není v současné době v nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/583 dostatečně upřesněn. Aby se dosáhlo konzistentního vykazování těchto ukazatelů a zvýšila se kvalita údajů, měly by tyto formáty vycházet ze stávajících tržních standardů a měly by být upřesněny.
- (8) Nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/583 by proto mělo být odpovídajícím způsobem změněno.
- (9) Aby obchodní systémy, schválené systémy pro uveřejňování informací a investiční podniky mohly zavést požadované změny do svých systémů, měly by se některé změny zavedené tímto nařízením použít od 1. ledna 2024. V zájmu zajištění právní jistoty a kontinuity pro obchody uskutečněné před 1. lednem 2024, které však byly uveřejněny nebo změněny až po tomto datu, by se na obchody uskutečněné před 1. lednem 2024 měl nadále vztahovat článek 12 a přílohy I, II a IV nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/583 ve znění platném k 31. prosinci 2023.
- (10) Toto nařízení vychází z návrhů regulačních technických norem předložených Komisi orgánem ESMA.
- (11) Orgán ESMA uskutečnil otevřené veřejné konzultace o návrzích regulačních technických norem, z nichž toto nařízení vychází, analyzoval potenciální související náklady a přínosy a požádal o stanovisko skupinu subjektů působících v oblasti cenných papírů a trhů zřízenou podle článku 37 nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 1095/2010 ⁽⁶⁾,

PŘIJALA TOTO NAŘÍZENÍ:

Článek 1

Změny nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/583

Nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/583 se mění takto:

- 1) v článku 4 se doplňuje nový odstavec 4, který zní:

„4. Pro účely odst. 2 písm. a) se velikost pokynů uchovávaných v systému na správu pokynů měří pomyslnou částkou obchodovaných smluv podle přílohy II tabulky 2 pole 10.“;

⁽⁶⁾ Nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 1095/2010 ze dne 24. listopadu 2010 o zřízení Evropského orgánu dohledu (Evropského orgánu pro cenné papíry a trhy), o změně rozhodnutí č. 716/2009/ES a o zrušení rozhodnutí Komise 2009/77/ES (Úř. věst. L 331, 15.12.2010, s. 84).

2) článek 12 se nahrazuje tímto:

„Článek 12

Použití poobchodní transparentnosti pro určité druhy obchodů prováděných mimo rámec obchodního systému

(čl. 21 odst. 1 nařízení (EU) č. 600/2014)

Povinnosti stanovené v čl. 21 odst. 1 nařízení (EU) č. 600/2014 se neuplatní na obchody uvedené v čl. 2 odst. 5 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 (*).

(*) Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/590 ze dne 28. července 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014, pokud jde o regulační technické normy pro hlášení obchodů příslušným orgánům (Úř. věst. L 87, 31.3.2017, s. 449).“;

3) článek 13 se mění takto:

a) v odstavci 5 se doplňuje nový pododstavec, který zní:

„Údaje uvedené v prvním pododstavci se shromažďují v souladu s přílohou V.“;

b) odstavce 17 a 18 se nahrazují tímto:

„17. Příslušné orgány zajistí uveřejnění výsledků výpočtů uvedených v odstavci 5 pro každý finanční nástroj a kategorii finančních nástrojů do 30. dubna následujícího roku po vstupu nařízení (EU) č. 600/2014 v použitelnost a do 30. dubna každý rok poté. Výsledky výpočtů se použijí od prvního pondělí měsíce června každého roku po uveřejnění až do dne předcházejícího prvnímu pondělí měsíce června následujícího roku.

18. Pro účely výpočtů uvedených v odst. 1 písm. b) bodu i) a odchylně od odstavců 7, 15 a 17 zajistí příslušné orgány v souvislosti s dluhopisy s výjimkou ETC a ETN uveřejnění výpočtů uvedených v odst. 5 písm. a) čtvrtletně první pondělí měsíce února, května, srpna a listopadu následující po vstupu nařízení (EU) č. 600/2014 v použitelnost a první pondělí měsíce února, května, srpna a listopadu každý rok poté. Výpočty zahrnují obchody provedené v Unii během předchozího kalendářního čtvrtletí a použijí se od třetího pondělí měsíce února, května, srpna a listopadu každého roku až do doby, kdy se použijí výpočty za následující čtvrtletní období.“;

4) příloha I se nahrazuje zněním uvedeným v příloze I tohoto nařízení;

5) příloha II se mění v souladu s přílohou II tohoto nařízení;

6) příloha III se mění v souladu s přílohou III tohoto nařízení;

7) příloha IV se mění v souladu s přílohou IV tohoto nařízení;

8) znění přílohy V tohoto nařízení se doplňuje jako příloha V.

Článek 2

Přechodné ustanovení

Článek 12 a přílohy I, II a IV nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/583 ve znění platném k 31. prosinci 2023 se nadále použijí na obchody provedené před 1. lednem 2024.

*Článek 3***Vstup v platnost a použitelnost**

Toto nařízení vstupuje v platnost dvacátým dnem po vyhlášení v *Úředním věstníku Evropské unie*.

Ustanovení čl. 1 bodů 2, 4, 5 a 7 se použijí od 1. ledna 2024.

Toto nařízení je závazné v celém rozsahu a přímo použitelné ve všech členských státech.

V Bruselu dne 17. ledna 2023.

Za Komisi
předsedkyně
Ursula VON DER LEYEN

PŘÍLOHA I

„PŘÍLOHA I

Popis druhu systému a souvisejících informací určených k uveřejnění podle článku 2

Druh systému	Popis systému	Informace určené k uveřejnění
System obchodování formou průběžné aukce na základě knihy objednávek	System, který na základě knihy objednávek a obchodního algoritmu průběžně bez lidského zásahu páruje pokyny k prodeji s pokyny ke koupi podle nejlepší dostupné ceny.	Pro každý finanční nástroj celkový počet pokynů a objem, který představují, v každé cenové hladině, a to nejméně pro pět nejlepších nabídkových a poptávkových cen.
System obchodování řízený kotacemi	System, při němž se obchody uzavírají na základě pevných kotací, jež mají účastníci průběžně k dispozici, a který vyžaduje, aby tvůrci trhu udržovali kotace v objemu, jenž zachovává rovnováhu mezi potřebami členů a účastníků obchodovat v komerčních objemech a rizikem, jemuž se vystavuje sám tvůrce trhu.	Pro každý finanční nástroj nejlepší poptávková a nabídková cena každého tvůrce trhu s tímto nástrojem, společně s objemem, který se k těmto cenám váže. Zveřejněné kotace představují závazné přísliby k nákupu a prodeji finančních nástrojů a uvádějí cenu a objem finančních nástrojů, za něž jsou registrovaní tvůrci trhu připraveni je koupit nebo prodat. Za výjimečných tržních podmínek však lze po omezenou dobu povolit orientační nebo jednostranné ceny.
System obchodování formou periodických aukcí	System, který páruje pokyny na základě periodické aukce a obchodního algoritmu provozovaného bez zásahu člověka.	Pro každý finanční nástroj cena, která by v systému obchodování formou aukce byla nejvíce v souladu s jeho obchodním algoritmem, a objem, který by byl za tuto cenu potenciálně realizovatelný účastníky tohoto systému.
System obchodování formou žádostí o kotace	System obchodování, při němž jsou jedna nebo více kotací poskytovány na základě žádosti o kotaci předložené jedním nebo více jinými členy nebo účastníky. Tato kotace je zobchodovatelná pouze žádajícím členem nebo účastníkem trhu. Žadající člen nebo účastník může obchod uzavřít přijetím jedné nebo více kotací, které mu byly na základě žádosti poskytnuty.	Kotace a k nim se vážící objemy libovolného člena nebo účastníka, jejichž přijetí by vedlo k uzavření obchodu podle pravidel systému. Veškeré kotace předložené na základě žádosti mohou být uveřejněny současně, nejspíše však tehdy, když se stanou zobchodovatelnými.
System hlasového obchodování	System obchodování, při němž jsou obchody organizovány prostřednictvím ústního jednání členů.	Poptávky a nabídky a k nim se vážící objemy libovolného člena nebo účastníka, jejichž přijetí by vedlo k uzavření obchodu podle pravidel systému.

Druh systému	Popis systému	Informace určené k uveřejnění
Hybridní systém obchodování	Systém spadající do dvou nebo více druhů obchodních systémů uvedených v řádcích 1 až 5 této tabulky.	U hybridních systémů obchodování, které kombinují různé systémy obchodování současně, požadavky odpovídají požadavkům na předobchodní transparentnost platným pro každý druh systému obchodování, který tvoří hybridní systém. U hybridních systémů obchodování, které kombinují dva nebo více systémů obchodování po sobě, požadavky odpovídají požadavkům na předobchodní transparentnost platným pro příslušný systém obchodování, který je v daném okamžiku provozovaný.
Všechny ostatní systémy obchodování	Jakýkoliv jiný druh systému obchodování neuvedený v řádcích 1 až 6.	Odpovídající informace o úrovni pokynů či kotovaných cenách a o obchodních zájmech; zejména pět nejlepších poptávkových a nabídkových cen a/nebo dvousměrných kotací každého tvůrce trhu s tímto nástrojem, pokud to umožňují parametry mechanismu určování cen.“

PŘÍLOHA II

Příloha II se mění takto:

1) Tabulka 2 se nahrazuje tímto:

„Tabulka 2

Seznam údajů pro účely poobchodní transparentnosti

Č.	Identifikátor pole	Finanční nástroje	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 1
1	Datum a čas obchodování	Pro všechny finanční nástroje	<p>Datum a čas, kdy byl obchod proveden.</p> <p>Pro obchody provedené v obchodním systému musí být míra podrobnosti v souladu s požadavky stanovenými v článku 2 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574 ⁽¹⁾.</p> <p>V případě obchodů, které nejsou provedeny v obchodním systému, datum a čas dohody stran na obsahu těchto polí: množství, cena, měny, jak jsou stanoveny v polích 31, 34 a 44 v tabulce 2 přílohy I nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, identifikační kód nástroje, klasifikace nástroje a popřípadě kód podkladového nástroje. V případě obchodů, které nejsou provedeny v obchodním systému, se čas uvádí s přesností alespoň na nejbližší sekundu.</p> <p>Pokud je obchod výsledkem pokynu předaného provádějícím podnikem jménem zákazníka třetí straně a pokud nebyly splněny podmínky pro předávání stanovené v článku 4 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590, uvádí se datum a čas obchodu, nikoli čas předání pokynu.</p>	<p>Regulovaný trh (RM)</p> <p>Mnohostranný obchodní systém (MTF), organizovaný obchodní systém (OTF)</p> <p>Schválený systém pro uveřejňování informací (APA)</p> <p>Poskytovatel konsolidovaných obchodních informací (CTP)</p>	{DATE_TIME_FORMAT}
2	Identifikační kód nástroje	Pro všechny finanční nástroje	Kód k identifikaci finančního nástroje	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{ISIN}
3	Cena	Pro všechny finanční nástroje	<p>Obchodovaná cena bez případné provize a vzniklého úroku.</p> <p>Obchodovaná cena se vykazuje v souladu se standardní tržní konvencí. Hodnota uvedená v tomto poli musí být v souladu s hodnotou uvedenou v poli „Cenová notace“.</p> <p>Pokud cena není právě k dispozici, ale čeká se na její určení („PNDG“) nebo není relevantní („NOAP“), toto pole se nevyplňuje.</p>	RM, MTF, OTF, APA, CTP	<p>{DECIMAL-18/13} pokud je cena vyjádřena peněžní hodnotou</p> <p>{DECIMAL-11/10} pokud je cena vyjádřena procentním podílem nebo výnosem</p> <p>{DECIMAL-18/17} pokud je cena vyjádřena v bazických bodech</p>

Č.	Identifikátor pole	Finanční nástroje	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 1
4	Chybějící cena	Pro všechny finanční nástroje	<p>Pokud cena není právě k dispozici, ale čeká se na její určení, hodnota bude „PNDG“.</p> <p>Je-li cena irelevantní, hodnota bude „NOAP“.</p>	RM, MTF, OTF, APA, CTP	<p>„PNDG“ pokud cena není k dispozici</p> <p>„NOAP“ pokud cena není relevantní</p>
5	Měna ceny	Pro všechny finanční nástroje	Hlavní měna, v níž je cena vyjádřena (v případě, že je cena vyjádřena peněžní hodnotou).	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{CURRENCYCODE_3}
6	Cenová notace	Pro všechny finanční nástroje	<p>Údaj o tom, zda je cena vyjádřena jako peněžní hodnota, procentní podíl, bazické body nebo výnos.</p> <p>Cenová notace se uvádí v souladu se standardní tržní konvencí.</p> <p>U swapů úvěrového selhání se do tohoto pole vyplní „BAPO“.</p> <p>U dluhopisů (jiných než ETN a ETC) se toto pole vyplní procentem („PERC“) pomyslné částky. Pokud cena v procentech není standardní tržní konvencí, vyplní se „YIEL“, „BAPO“ nebo „MONE“ v souladu se standardní tržní konvencí.</p> <p>Hodnota uvedená v tomto poli musí být v souladu s hodnotou uvedenou v poli „Cena“.</p> <p>Pokud se cena oznamuje v peněžní hodnotě, uvádí se v hlavní měnové jednotce.</p> <p>Pokud cena není právě k dispozici, ale čeká se na její určení („PNDG“) nebo není relevantní („NOAP“), toto pole se nevyplňuje.</p>	RM, MTF, OTF, APA, CTP	<p>„MONE“ – peněžní hodnota</p> <p>„PERC“ – procento,</p> <p>„YIEL“ – výnos</p> <p>„BAPO“ – bazické body</p>

Č.	Identifikátor pole	Finanční nástroje	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 1
7	Množství	Pro všechny finanční nástroje s výjimkou případů popsaných v čl. 11 odst. 1 písm. a) a b) tohoto nařízení.	U finančních nástrojů obchodovaných v jednotkách počet jednotek finančního nástroje. Jinak se nevyplňuje.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/17}
8	Množství v měrné jednotce	Pro smlouvy označené v jednotkách u komoditních derivátů, derivátů C10, derivátů povolenek na emise a povolenek na emise s výjimkou případů popsaných v čl. 11 odst. 1 písm. a) a b) tohoto nařízení.	Odpovídající hodnota obchodovaných komodit nebo povolenek na emise vyjádřená v měrné jednotce.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/17}
9	Notace množství v měrné jednotce	Pro smlouvy určené v jednotkách u komoditních derivátů, derivátů C10, derivátů povolenek na emise a povolenek na emise s výjimkou případů popsaných v čl. 11 odst. 1 písm. a) a b) tohoto nařízení	Údaj o notaci, jíž se zapisuje množství v měrné jednotce.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	„TOCD“ – tuny ekvivalentu oxidu uhličitého pro každou smlouvu týkající se povolenek na emise „TONE“ – metrické tuny „MWHO“ – megawatthodiny „MBTU“ – jeden milion britských tepelných jednotek „THMS“ – thermy „DAYS“ – dny nebo {ALPHANUM-4} jinak

Č.	Identifikátor pole	Finanční nástroje	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 1
10	Pomyslná částka	Pro všechny finanční nástroje s výjimkou případů popsaných v čl. 11 odst. 1 písm. a) a b) tohoto nařízení.	<p>Toto pole se vyplní:</p> <ul style="list-style-type: none"> i) u dluhopisů (s výjimkou ETC a ETN) nominální hodnotou, což je částka vyplacená investorovi při splacení; ii) u ETC a ETN a sekuritizovaných derivátů počtem nástrojů vyměněných mezi kupujícími a prodávajícími vynásobeným cenou vyměněného nástroje v rámci daného obchodu. Popřípadě údajem z pole cena vynásobeným údajem z pole množství; iii) u strukturovaných finančních produktů nominální hodnotou na jednotku vynásobenou počtem nástrojů v době obchodu; iv) u swapů úvěrového selhání pomyslnou hodnotou, na kterou se vztahuje nabyté nebo převedené zajištění; v) u opcí, swapcí, swapů jiných než uvedených v bodě iv), futures a forwardů pomyslnou hodnotou smlouvy; vi) u povolenek na emise výsledným množstvím za příslušnou cenu stanovenou ve smlouvě v době obchodu. Popřípadě údajem z pole cena vynásobeným údajem z pole množství v měrné jednotce; vii) u sázek na rozpětí peněžní hodnotou vsazenou na pohyb bodů v podkladovém finančním nástroji v době obchodu; viii) u rozdílových smluv počtem nástrojů vyměněných mezi kupujícími a prodávajícími vynásobeným cenou nástroje vyměněného v rámci daného obchodu. Popřípadě údajem z pole cena vynásobeným údajem z pole množství. 	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

Č.	Identifikátor pole	Finanční nástroje	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 1
11	Jmenovitá měna	Pro všechny finanční nástroje s výjimkou případů popsaných v čl. 11 odst. 1 písm. a) a b) tohoto nařízení.	Hlavní měna, v níž je denominována pomyslná částka. U měnového derivátu nebo swapu více měn nebo swapce, kde je podkladový swap víceměnový nebo měnová rozdílová smlouva nebo smlouva týkající se sázek na rozpětí, se jedná o pomyslnou měnu komponenty 1.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{CURRENCYCODE_3}
12	Druh	Pouze pro povolenky na emise a deriváty povolenek na emise	Toto pole se použije pouze pro povolenky na emise a deriváty povolenek na emise.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	„EUAE“ – EUA „CERE“ – CER „ERUE“ – ERU „EUAA“ – EUAA „OTHR“ – jiné
13	Místo provedení	Pro všechny finanční nástroje	Identifikace místa, kde byl obchod proveden. Pro obchody provedené v obchodním systému EU použijte MIC tržního segmentu podle ISO 10383. Pokud MIC tržního segmentu neexistuje, použijte operační MIC. Pro finanční nástroje přijaté k obchodování nebo obchodované v obchodním systému, kde je obchod týkající se daného finančního nástroje proveden prostřednictvím systematického internalizátora, použijte „SINT“. Pokud v případě finančních nástrojů přijatých k obchodování nebo obchodovaných v obchodním systému není obchod s daným finančním nástrojem proveden v obchodním systému EU ani prostřednictvím systematického internalizátora, použije se kód MIC „XOFF“. Pokud je obchod proveden na organizované obchodní platformě mimo EU, pak je kromě „XOFF“ vyžadováno také vyplnění pole „Obchodní místo provedení ve třetí zemi“.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{MIC} – obchodní systémy EU nebo „SINT“ – systematický internalizátor „XOFF“ – jinak

Č.	Identifikátor pole	Finanční nástroje	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 1
14	Obchodní místo provedení ve třetí zemi	Pro všechny finanční nástroje	<p>Identifikace obchodního systému třetí země, kde byl obchod proveden.</p> <p>Použijte MIC segment podle ISO 10383. Pokud MIC tržního segmentu neexistuje, použijte operační MIC.</p> <p>Pokud obchod není proveden v obchodním systému třetí země, pole se nevyplňuje.</p>	APA, CTP	{MIC}
15	Datum a čas zveřejnění	Pro všechny finanční nástroje	<p>Datum a čas, kdy byl obchod uveřejněn obchodním systémem nebo schváleným systémem pro uveřejňování informací.</p> <p>Pro obchody provedené v obchodním systému musí být míra podrobnosti v souladu s požadavky stanovenými v článku 2 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/574.</p> <p>V případě obchodů, které nejsou provedeny v obchodním systému, se oznamovaný čas uvádí s přesností alespoň na nejbližší sekundu.</p>	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DATE_TIME_FORMAT}
16	Místo uveřejnění	Pro všechny finanční nástroje	Kód sloužící k identifikaci obchodního systému a schváleného systému pro uveřejňování informací uveřejňujícího obchod.	CTP	<p>Obchodní systém {MIC}</p> <p>APA: {MIC}, je-li k dispozici. V opačném případě čtyřmístný kód uveřejněný v seznamu poskytovatelů služeb hlášení údajů na internetových stránkách orgánu ESMA.</p>
17	Identifikační kód obchodu	Pro všechny finanční nástroje	Alfanumerický kód přidělený danému obchodu obchodním systémem (v souladu s článkem 12 nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580 ⁽²⁾) a schváleným systémem pro uveřejňování informací, který se používá při každém dalším odkazu na daný obchod.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{ALPHANUMERICAL-52}

Č.	Identifikátor pole	Finanční nástroje	Popis a údaje, které mají být uveřejněny	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát vyplnění podle tabulky 1
			<p>Identifikační kód obchodu musí být jedinečný, konzistentní a trvalý pro každý MIC segmentu dle ISO 10383 a obchodní den. Pokud obchodní systém nepoužívá MIC segmentu, musí být identifikační kód obchodu jedinečný, konzistentní a trvalý pro každý operační MIC a obchodní den.</p> <p>V případě, že APA nepoužívá kódy MIC, musí být identifikační kód obchodu jedinečný, konzistentní a trvalý pro čtyřmístný kód použitý k identifikaci APA a daný obchodní den.</p> <p>Z komponent identifikačního kódu obchodu nesmí být patrná totožnost protistran daného obchodu, k němuž se kód vztahuje.</p>		
18	Obchody, které mají být předmětem clearingů	Pro deriváty	Kód určený k identifikaci toho, zda bude obchod předmětem clearingů.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	<p>„TRUE“ – obchod má být předmětem clearingů</p> <p>„FALSE“ – obchod nemá být předmětem clearingů</p>

(¹) Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/574 ze dne 7. června 2016, kterým se doplňuje směrnice Evropského parlamentu a Rady 2014/65/EU, pokud jde o regulační technické normy týkající se míry přesnosti obchodních hodin (Úř. věst. L 87, 31.3.2017, s. 148).

(²) Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2017/580 ze dne 24. června 2016, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 600/2014, pokud jde o regulační technické normy pro uchovávání příslušných údajů o pokynech týkajících se finančních nástrojů (Úř. věst. L 87, 31.3.2017, s. 193).

Nařízení v přenesené pravomoci (EU) č. 148/2013, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 648/2012 o OTC derivátech, ústředních protistranách a registrech obchodních údajů, pokud jde o regulační technické normy týkající se minimálních údajů, které mají být vykazány do registrů obchodních údajů.“

2) Tabulka 3 se nahrazuje tímto:

„Tabulka 3

Seznam označení pro účely poobchodní transparentnosti

Označení	Název	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Popis
„BENC“	Označení referenčního obchodu	RM, MTF, OTF, APA, CTP	Obchod je proveden s odkazem na cenu, která je vypočtena ve více okamžicích na základě dané referenční hodnoty, jako je například průměrná cena vážená objemem nebo průměrná cena vážená časem.
„ACTX“	Označení pro duální obchod	APA, CTP	Obchody, ve kterých investiční podnik spároval pokyny dvou zákazníků prostřednictvím nákupu a prodeje provedených jako jeden obchod a zahrnujících stejný objem a cenu.
„NPFT“	Označení obchodů, při nichž se netvoří ceny	RM, MTF, OTF, CTP	Obchody, při nichž se netvoří ceny, podle čl. 2 odst. 5 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/590.

Označení	Název	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Popis
„LRGS“	Označení obchodu s poobchodním odkladem z důvodu velkého rozsahu	RM, MTF, OTF APA CTP	Obchody provedené v rámci poobchodního odkladu z důvodu velkého rozsahu.
„ILQD“	Označení obchodu s nelikvidními finančními nástroji	RM, MTF, OTF, APA, CTP	Obchody provedené v rámci odkladu pro nástroje, pro které neexistuje likvidní trh.
„SIZE“	Označení obchodu s poobchodním odkladem z důvodu SSTI	RM, MTF, OTF APA, CTP	Obchody provedené v rámci poobchodního odkladu pro konkrétní objem pro daný nástroj.
„TPAC“	Označení souborného obchodu	RM, MTF, OTF, APA, CTP	Souborné obchody, které nepředstavují výměnu za hmotná aktiva podle článku 1.
„XFPH“	Označení obchodu představujícího výměnu za hmotná aktiva	RM, MTF, OTF, APA, CTP	Výměna za hmotná aktiva podle definice v článku 1.
„CANC“	Označení zrušeného obchodu	RM, MTF, APA, CTP	Je-li dříve uveřejněný obchod zrušen.
„AMND“	Označení změny	RM, MTF, APA, CTP	Je-li dříve uveřejněný obchod změněn.
„PORT“	Označení portfoliového obchodu	RM, MTF, APA, CTP	Obchod s pěti nebo více různými finančními nástroji, pokud jsou tyto obchody realizovány ve stejnou dobu stejným klientem a za jednu souhrnnou cenu a nejedná se o „souborný obchod“ podle čl. 1 odst. 1.

OZNAČENÍ DODATEČNÉHO ODKLADU

Čl. 11 odst. 1 písm. a) bod i)	„LMTF“	Označení omezených podrobností	RM, MTF, OTF, APA, CTP	První hlášení s uveřejněním omezených podrobností v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. a) bodem i).
	„FULF“	Označení úplných podrobností		Obchody, pro které byly dříve uveřejněny omezené podrobnosti v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. a) bodem i).
Čl. 11 odst. 1 písm. a) bod ii)	„DATE“	Označení pro denní souhrn obchodů	RM, MTF, OTF, APA, CTP	Uveřejnění denního souhrnu obchodů v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. a) bodem ii).
	„FULA“	Označení úplných podrobností		Jednotlivé obchody, pro které byl dříve uveřejněn souhrn podrobností v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. a) bodem ii).

Čl. 11 odst. 1 písm. b)	„VOLO“	Označení pro neuveřejnění údajů o objemu	RM, MTF, OTF, APA, CTP	Obchody, pro které jsou uveřejněny omezené podrobnosti v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. b).
	„FULV“	Označení úplných podrobností	RM, MTF, OTF, APA, CTP	Obchody, pro které byly dříve uveřejněny omezené podrobnosti v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. b).
Čl. 11 odst. 1 písm. c)	„FWAF“	Označení čtyřtýdenního souhrnu	RM, MTF, OTF, APA, CTP	Uveřejnění souhrnu obchodů v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. c).
	„FULJ“	Označení úplných podrobností	RM, MTF, OTF, APA, CTP	Jednotlivé obchody, pro které byl dříve uveřejněn souhrn údajů v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. c).
Čl. 11 odst. 1 písm. d)	„IDAF“	Označení pro neomezené uveřejnění v souhrnné podobě	RM, MTF, OTF, APA, CTP	Obchody, pro které bylo v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. d) povoleno uveřejnění několika obchodů v souhrnné podobě po neomezené časové období.
Pro státní dluhové nástroje se následně použije čl. 11 odst. 1 písm. b) a čl. 11 odst. 2 písm. c).	„VOLW“	Označení pro neuveřejnění údajů o objemu	RM, MTF, OTF, APA, CTP	Obchody, pro které jsou uveřejňovány omezené podrobnosti v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. b) a pro které bude následně povoleno uveřejňování několika obchodů v souhrnné podobě po neomezené časové období v souladu s čl. 11 odst. 2 písm. c).
	„COAF“	Označení následného souhrnu (následujícího po neuveřejnění údajů o objemu pro veřejnoprávní dluhopisy)	RM, MTF, OTF, APA, CTP	Obchody, pro které byly dříve uveřejněny omezené podrobnosti v souladu s čl. 11 odst. 1 písm. b) a pro které bylo následně povoleno uveřejňování několika obchodů v souhrnné podobě po neomezené časové období v souladu s čl. 11 odst. 2 písm. c).“

3) Tabulka 4 se nahrazuje tímto:

„Tabulka 4

Míra objemu

Druh nástroje	Objem
Všechny dluhopisy s výjimkou ETC a ETN a strukturovaných finančních produktů	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Druhy dluhopisů ETC a ETN	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Sekuritizované deriváty	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Úrokové deriváty	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.

Druh nástroje	Objem
Měnové deriváty	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Akciové deriváty	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Komoditní deriváty	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Úvěrové deriváty	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Rozdílové smlouvy	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Deriváty C10	„Pomyslná částka“ obchodované smlouvy podle pole 10 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Deriváty povolenek na emise	„Množství v měrné jednotce“ podle pole 8 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.
Povolenky na emise	„Množství v měrné jednotce“ podle pole 8 tabulky 2 přílohy II tohoto nařízení.“

Příloha III se mění takto:

1) V části 1 se bod 13 nahrazuje tímto:

„13. „Swapcí“ nebo „opcí na swap“ se rozumí smlouva, která dává vlastníkovi právo, ale nikoli povinnost, vstoupit k určitému budoucímu datu nebo datu realizace nebo do určitého budoucího data nebo data realizace do swapu.“

2) Tabulka 2.2 se nahrazuje tímto:

„Tabulka 2.2

Dluhopisy (všechny druhy dluhopisů s výjimkou ETC a ETN) – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – dluhopisy (všechny druhy dluhopisů s výjimkou ETC a ETN)			
Každý jednotlivý dluhopis se určí jako nemající likvidní trh podle čl. 13 odst. 18, pokud je charakterizován specifickou kombinací druhu dluhopisu a objemu emise, jak jsou uvedeny v každém řádku tabulky.			
Druh dluhopisu		Objem emise – RTS23#14	
Státní dluhopis RTS2#3 = BOND a RTS2#9 = EUSB	Tímto dluhopisem se rozumí dluhopis, který není konvertibilní ani krytý a vydal jej veřejnoprávní emitent: a) Unie; b) členský stát, včetně jakéhokoli ministerstva, vládní organizace nebo zvláštní účelové jednotky členského státu; c) veřejnoprávní subjekt, který není uveden v písmenech a) a b).	menší než (v EUR)	1 000 000 000

Kategorie aktiv – dluhopisy (všechny druhy dluhopisů s výjimkou ETC a ETN)			
Druh dluhopisu		Objem emise – RTS23#14	
Jiný veřejný dluhopis RTS2#3 = BOND a RTS2#9 = OEPB	Tímto dluhopisem se rozumí dluhopis, který není konvertibilní ani krytý a vydal jej kterýkoliv z následujících veřejných emitentů: a) v případě federativního členského státu člen federace; b) zvláštní účelová jednotka pro několik členských států; c) mezinárodní finanční instituce zřízená dvěma nebo více členskými státy, jejímž účelem je získávat finanční prostředky a poskytovat finanční pomoc ve prospěch svých členů, kteří jsou postiženi nebo ohroženi vážnými finančními problémy; d) Evropská investiční banka; e) veřejný subjekt, který není emitentem státního dluhopisu uvedeného v předchozím řádku.	menší než (v EUR) 500 000 000	
Konvertibilní dluhopis RTS2#3 = BOND a RTS2#9 = CVTB	Tímto dluhopisem se rozumí nástroj sestávající z dluhopisu nebo sekuritizovaného dluhového nástroje s vloženým derivátem, například opce na koupi podkladového kapitálového nástroje	menší než (v EUR) 500 000 000	
Krytý dluhopis RTS2#3 = BOND a RTS2#9 = CVDB	Tímto dluhopisem se rozumí dluhopisy uvedené v čl. 52 odst. 4 směrnice 2009/65/ES	během fází S1 a S2	
		menší než (v EUR) 1 000 000 000	menší než (v EUR) 500 000 000

Kategorie aktiv – dluhopisy (všechny druhy dluhopisů s výjimkou ETC a ETN)					
Druh dluhopisu		Objem emise – RTS23#14			
		během fází S1 a S2		během fází S3 a S4	
Podnikový dluhopis RTS2#3 = BOND a RTS2#9 = CRPB	Tímto dluhopisem se rozumí dluhopis, který není konvertibilní ani krytý a je vydán evropskou akciovou společností (Societas Europaea) zřízenou v souladu s nařízením Rady (ES) č. 2157/2001 ⁽¹⁾ nebo některou z forem společností uvedených v příloze I nebo II směrnice Evropského parlamentu a Rady 2013/34/EU ⁽²⁾ nebo jejich ekvivalentem ve třetích zemích.	menší než (v EUR)	1 000 000 000	menší než (v EUR)	500 000 000
Druh dluhopisu	Pro účely určení finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle čl. 13 odst. 18 se použije následující metodika				
Jiný dluhopis RTS2#3 = BOND a RTS2#9 = OTHR	Dluhopis, který nepatří mezi žádné z výše uvedených druhů dluhopisů, se považuje za nemající likvidní trh.				

⁽¹⁾ Nařízení Rady (ES) č. 2157/2001 ze dne 8. října 2001 o statutu evropské společnosti (SE) (Úř. věst. L 294, 10.11.2001, s. 1).

⁽²⁾ Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2013/34/EU ze dne 26. června 2013 o ročních účetních závěrkách, konsolidovaných účetních závěrkách a souvisejících zprávách některých forem podniků, o změně směrnice Evropského parlamentu a Rady 2006/43/ES a o zrušení směrnic Rady 78/660/EHS a 83/349/EHS (Úř. věst. L 182, 29.6.2013, s. 19).⁴

3) Tabulka 2.4 se nahrazuje tímto:

„Tabulka 2.4

Dluhopisy (druhy dluhopisů ETC a ETN) – kategorie nemající likvidní trh

Druh dluhopisu	Každý jednotlivý finanční nástroj se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity	
	Průměrný denní obrat [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
<p>Komodity obchodované v obchodním systému (Exchange Traded Commodities, ETC) – RTS2#3 = ETCS</p> <p>Dluhový nástroj vydaný emitentem v komoditách nebo komoditních derivátech proti přímé investici. Cena ETC je přímo nebo nepřímo závislá na vývoji podkladového nástroje. ETC pasivně sleduje vývoj komodity nebo indexů komodit, ke kterým se vztahuje.</p>	500 000 EUR	10
<p>Dluhové cenné papíry obchodované v obchodním systému (Exchange Traded Notes, ETN) – RTS2#3 = ETNS</p> <p>Dluhový nástroj vydaný emitentem v podkladových nástrojích nebo podkladových derivátech proti přímé investici. Cena ETN je přímo nebo nepřímo závislá na vývoji podkladového nástroje. ETN pasivně sleduje vývoj podkladového nástroje, ke kterému se vztahuje.</p>	500 000 EUR	10“

4) Tabulka 3.1 se nahrazuje tímto:

„Tabulka 3.1

Strukturované finanční produkty – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – Strukturované finanční produkty (SFP)
Zkouška 1 – posouzení kategorie aktiv SFP

Posouzení kategorie aktiv SFP pro účely určení finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) – RTS2#3 = SFPS

Obchody, které se zohlední pro výpočet hodnot týkajících se kvantitativních kritérií likvidity pro účely posouzení kategorie aktiv SFP	Kategorie aktiv SFP se posoudí použitím následujících prahových hodnot kvantitativních kritérií likvidity	
	Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
Obchody prováděné ve všech SFP	300 000 000 EUR	500

Zkouška 2 – SFP nemající likvidní trh
--

Pokud se obě hodnoty týkající se kvantitativních kritérií likvidity nacházejí nad kvantitativními prahovými hodnotami likvidity stanovenými pro účely posouzení kategorie aktiv SFP, je zkouška 1 splněna a provede se zkouška 2. Každý jednotlivý finanční nástroj se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity

Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Podíl obchodovaných dní v posuzovaném období [kvantitativní kritéria likvidity 3]
100 000 EUR	2	80 %“

5) Tabulka 4.1 se nahrazuje tímto:

„Tabulka 4.1

Sekuritizované deriváty – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – sekuritizované deriváty

Těmito deriváty se rozumí převoditelný cenný papír ve smyslu čl. 4 odst. 1 bodu 44) písm. c) směrnice 2014/65/EU lišící se od strukturovaných finančních produktů, který zahrnuje nejméně:

- a.1) standardní kryté warranty, kterými se rozumí cenné papíry vydané finanční institucí dávající držiteli právo, nikoliv však povinnost
 - a) koupit k datu ukončení platnosti nebo do data ukončení platnosti určité množství podkladového aktiva za předem stanovenou realizační cenu, nebo v případě, že bylo stanoveno hotovostní vypořádání, přijmout úhradu kladného rozdílu mezi aktuální tržní cenou a realizační cenou od prodávajícího, nebo
 - b) prodat k datu ukončení platnosti nebo do data ukončení platnosti určité množství podkladového aktiva za předem stanovenou realizační cenu, nebo v případě, že bylo stanoveno hotovostní vypořádání, přijmout úhradu kladného rozdílu mezi realizační cenou a aktuální tržní cenou od kupujícího;
- a.2) warranty, kterými se rozumí cenné papíry vydané stejným emitentem podkladového aktiva dávající držiteli právo, nikoliv však povinnost
 - a) koupit k datu ukončení platnosti nebo do data ukončení platnosti určité množství podkladového aktiva za předem stanovenou realizační cenu, nebo v případě, že bylo stanoveno hotovostní vypořádání, přijmout úhradu kladného rozdílu mezi aktuální tržní cenou a realizační cenou od prodávajícího, nebo
 - b) prodat k datu ukončení platnosti nebo do data ukončení platnosti určité množství podkladového aktiva za předem stanovenou realizační cenu, nebo v případě, že bylo stanoveno hotovostní vypořádání, přijmout úhradu kladného rozdílu mezi realizační cenou a aktuální tržní cenou od kupujícího;
- b) spekulativní certifikáty (leverage certificate), kterými se rozumí certifikáty, které sledují vývoj podkladového aktiva se spekulativním účinkem;
- c) exotické kryté warranty (exotic covered warrants), kterými se rozumí kryté warranty, jejichž hlavní složkou je kombinace opcí;
- d) obchodovatelná práva, jejichž podkladovým nástrojem je nekapitálový nástroj;
- e) investiční certifikáty, kterými se rozumí certifikáty, které sledují vývoj podkladového aktiva bez spekulativního účinku.

RTS2#3 = SDRV

Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika

Všechny sekuritizované deriváty se považují za mající likvidní trh.“

6) Tabulka 5.1 se nahrazuje tímto:

„Tabulka 5.1

Úrokové deriváty – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – úrokové deriváty				
Jakákoli smlouva ve smyslu přílohy I oddílu C bodu 4 směrnice 2014/65/EU, jejímž hlavním podkladovým nástrojem je úroková sazba, dluhopis, půjčka, jakýkoli koš, portfolio nebo index zahrnující úrokovou sazbu, dluhopis, půjčku nebo jakýkoli jiný produkt představující vývoj úrokové sazby, dluhopisu, půjčky.				
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nespĺňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity
<p>Dluhopisové futures/forwardy</p> <p>/ Future na dluhopisový future</p> <p>/ Forward na dluhopisový future</p> <p>Future na dluhopis</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = FUTR</p> <p>RTS2#16 = BOND</p> <p>nebo</p>	<p>Podkategorie dluhopisových futures/forwardů je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS2#17) – emitent podkladového nástroje</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#18) – termín podkladového dodatečného dluhopisu definovaný takto:</p> <p>Krátkodobý: podkladový dodatečný dluhopis s termínem do 4 let se považuje za krátkodobý</p> <p>Střednědobý: podkladový dodatečný dluhopis s termínem mezi 4 a 8 roky se považuje za střednědobý</p>	5 000 000 EUR	10	<p>Kdykoli je podkategorie určena jako mající likvidní trh, pokud jde o konkrétní čas do doby zbytkové splatnosti, a podkategorie definovaná příštím časem do doby zbytkové splatnosti je určena jako nemající likvidní trh, je smlouva s prvním nejzazším měsícem splatnosti (back month) určena jako mající likvidní trh 2 týdny před vypršením prvního měsíce splatnosti (front month).</p>

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity
<p>Forward na dluhopis</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = FORW</p> <p>RTS2#16 = BOND</p> <p>nebo</p> <p>Future na dluhopisový future</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = FUTR</p> <p>RTS2#16 = BNFD</p> <p>nebo</p> <p>Forward na dluhopisový future</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = FORW</p> <p>RTS2#16 = BNFD</p>	<p>Dlouhodobý: podkladový dodatečný dluhopis s termínem mezi 8 a 15 roky se považuje za dlouhodobý</p> <p>Ultra-dlouhodobý: podkladový dodatečný dluhopis s termínem delším než 15 let se považuje za ultradlouhodobý</p> <p>Kritérium pro segmentaci 3 – čas do doby zbytkové splatnosti futures definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3$ měsíce</p> <p>Zbytková splatnost 2: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 6$ měsíců</p> <p>Zbytková splatnost 3: $6 \text{ měsíců} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1$ rok</p> <p>Zbytková splatnost 4: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2$ roky</p> <p>Zbytková splatnost 5: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3$ roky</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n$ let</p>			

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity
<p>Opce na dluhopisy / Opce na dluhopisovou opci / Opce na dluhopisový future</p> <p>Opce na dluhopisy Opce na dluhopisovou opci RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = OPTN RTS2#16 = BOND</p> <p>nebo</p> <p>Opce na dluhopisovou opci RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = OPTN RTS2#16 = BOND</p> <p>nebo</p> <p>Opce na dluhopisový future RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = OPTN RTS2#16 = BNFD</p>	<p>Podkategorie dluhopisových opcí je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS2#22) – hlavní podkladový dluhopis</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce</p> <p>Zbytková splatnost 2: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců</p> <p>Zbytková splatnost 3: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</p> <p>Zbytková splatnost 4: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</p> <p>Zbytková splatnost 5: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let</p>	5 000 000 EUR	10	

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity
<p>Úrokové futures a dohody o forwardových úrokových mírách / Future na úrokový future / Dohoda o forwardových úrokových mírách na úrokový future</p> <p>Úrokový future RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FUTR RTS2#16 = INTR</p> <p>nebo</p> <p>Dohoda o forwardových úrokových mírách RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FRAS RTS2#16 = INTR</p> <p>nebo</p> <p>Future na úrokový future RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FUTR RTS2#16 = IFUT</p> <p>nebo</p> <p>Dohoda o forwardových úrokových mírách na úrokový future RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FRAS RTS2#16 = IFUT</p>	<p>Podkategorie úrokových futures je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS2#24) – podkladová úroková sazba</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#25) – termín podkladové úrokové sazby</p> <p>Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti futures definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3$ měsíce</p> <p>Zbytková splatnost 2: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 6$ měsíců</p> <p>Zbytková splatnost 3: $6 \text{ měsíců} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1$ rok</p> <p>Zbytková splatnost 4: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2$ roky</p> <p>Zbytková splatnost 5: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3$ roky</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n$ let</p>	500 000 000 EUR	10	<p>Kdykoli je podkategorie určena jako mající likvidní trh, pokud jde o konkrétní čas do doby zbytkové splatnosti, a podkategorie definovaná příštím časem do doby zbytkové splatnosti je určena jako nemající likvidní trh, je smlouva s prvním nejzazším měsícem splatnosti (back month) určena jako mající likvidní trh 2 týdny před vypršením prvního měsíce splatnosti (front month).</p>

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity
<p>Úrokové opce / Opce na úrokový future / dohodu o forwardových úrokových mírách / Opce na úrokovou opci / Opce na opci na úrokový future / dohodu o forwardových úrokových mírách</p> <p>Opce na úrokový future / dohodu o forwardových úrokových mírách // Opce na úrokovou opci RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = OPTN RTS2#16 = IFUT nebo Úroková opce // Opce na opci na úrokový future / dohodu o forwardových úrokových mírách RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = OPTN RTS2#16 = INTR</p>	<p>Podkategorie úrokových opcí je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS2#24) – podkladová úroková sazba</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#25) – termín podkladové úrokové sazby</p> <p>Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3$ měsíce</p> <p>Zbytková splatnost 2: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 6$ měsíců</p> <p>Zbytková splatnost 3: $6 \text{ měsíců} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1$ rok</p> <p>Zbytková splatnost 4: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2$ roky</p> <p>Zbytková splatnost 5: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3$ roky</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n$ let</p>	500 000 000 EUR	10	

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity
Swapce RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWPT	<p>Podkategorie swapcí je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS2#16) – podkladový druh swapu definovaný takto: měnový swap jedné měny, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami (fixed-to-fixed single currency swap), futures/forwardy na měnový swap jedné měny, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami [RTS2#16 = XXSC]</p> <p>měnový swap jedné měny, kdy probíhá swap měny s pevnou úrokovou sazbou a měny s pohyblivou úrokovou sazbou (fixed-to-float single currency swap), futures/forwardy na měnový swap jedné měny, kdy probíhá swap měny s pevnou úrokovou sazbou a měny s pohyblivou úrokovou sazbou [RTS2#16 = XFSC]</p> <p>měnový swap jedné měny, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami (float-to-float single currency swap), futures/forwardy na měnový swap jedné měny, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami [RTS2#16 = FFSC]</p> <p>inflační měnový swap jedné měny (inflation single currency swap), futures/forwardy na inflační měnový swap jedné měny [RTS2#16 = IFSC]</p> <p>swap jedné měny na bázi OIS (OIS single currency swap), futures/forwardy na swap jedné měny na bázi OIS [RTS2#16 = OSSC]</p> <p>měnový swap více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou (fixed-to-fixed multi-currency swap), futures/forwardy na měnový swap více měn, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami [RTS2#16 = XXMC]</p> <p>měnový swap více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou a měn s pohyblivou úrokovou sazbou (fixed-to-float multi-currency swap), futures/forwardy na měnový swap více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou a měn s pohyblivou úrokovou sazbou [RTS2#16 = XFMC]</p>	500 000 000 EUR	10	

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity
	<p>měnový swap více měn, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami (float-to-float multi-currency swap), futures/forwardy na měnový swap více měn, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami [RTS2#16 = FFMC]</p> <p>inflační měnový swap více měn (inflation multi-currency swap), futures/forwardy na inflační měnový swap více měn [RTS2#16 = IFMC]</p> <p>swap více měn na bázi OIS (OIS multi-currency swap), futures/forwardy na swap více měn na bázi OIS [RTS2#16 = OSMC]</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#20) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka opce</p> <p>Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#22 nebo RTS2#23) – index inflace, je-li podkladovým druhem swapu buď inflační měnový swap jedné měny, nebo inflační měnový swap více měn</p> <p>Kritérium pro segmentaci 4 (RTS2#21) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ měsíc}$</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ měsíc} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ měsíce}$</p> <p>Zbytková splatnost 3: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 6 \text{ měsíců}$</p>			

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity
	<p>Zbytková splatnost 4: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</p> <p>Zbytková splatnost 5: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</p> <p>Zbytková splatnost 6: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let</p> <p>Kritérium pro segmentaci 5 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců</p> <p>Zbytková splatnost 2: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</p> <p>Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</p> <p>Zbytková splatnost 4: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 5 roky</p> <p>Zbytková splatnost 5: 5 roky < čas do doby splatnosti ≤ 10 roky</p> <p>Zbytková splatnost 6: nad 10 let</p>			

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity
<p>Měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou a měn s pohyblivou úrokovou sazbou (multi-currency swaps nebo cross-currency swaps) a futures/forward/opce na měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou a měn s pohyblivou úrokovou sazbou</p> <p>Swap nebo futures/forward/opce na swap, kdy si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované v různých měnách a peněžní toky jedné komponenty jsou určeny pevnou úrokovou sazbou a peněžní toky druhé komponenty jsou určeny pohyblivou úrokovou sazbou.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS</p> <p>RTS2#16 = XFMC</p>	<p>Podkategorie měnových swapů více měn, kdy probíhá swap měn s pevnou úrokovou sazbou a měn s pohyblivou úrokovou sazbou, je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#13 a RTS23#42) – dvojice jmenovitých měn definovaná jako kombinace dvou měn, v nichž jsou denominovány dané dvě komponenty swapu</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{splatnost} \leq 1$ měsíc</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ měsíc} < \text{splatnost} \leq 3$ měsíce</p> <p>Zbytková splatnost 3: $3 \text{ měsíce} < \text{splatnost} \leq 6$ měsíců</p> <p>Zbytková splatnost 4: $6 \text{ měsíců} < \text{splatnost} \leq 1$ rok</p> <p>Zbytková splatnost 5: $1 \text{ rok} < \text{splatnost} \leq 2$ roky</p> <p>Zbytková splatnost 6: $2 \text{ roky} < \text{splatnost} \leq 3$ roky</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n$ let</p>	50 000 000 EUR	10	

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity
<p>Měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami (multi-currency swaps nebo cross-currency swaps) a futures/forwardy/opce na měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami</p> <p>Swap nebo future/forward/opce na swap, kdy si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované v různých měnách a kde jsou peněžní toky obou komponent určeny pohyblivými úrokovými sazbami</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS</p> <p>RTS2#16 = FFMC</p>	<p>Podkategorie měnových swapů více měn, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami, je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#13 a RTS23#42) – dvojice jmenovitých měn definovaná jako kombinace dvou měn, v nichž jsou denominovány dané dvě komponenty swapu</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{splatnost} \leq 1$ měsíc</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ měsíc} < \text{splatnost} \leq 3$ měsíce</p> <p>Zbytková splatnost 3: $3 \text{ měsíce} < \text{splatnost} \leq 6$ měsíců</p> <p>Zbytková splatnost 4: $6 \text{ měsíců} < \text{splatnost} \leq 1$ rok</p> <p>Zbytková splatnost 5: $1 \text{ rok} < \text{splatnost} \leq 2$ roky</p> <p>Zbytková splatnost 6: $2 \text{ roky} < \text{splatnost} \leq 3$ roky</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n \text{ let}$</p>	50 000 000 EUR	10	

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity
<p>Měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami (multi-currency swaps nebo cross-currency swaps), a futures/forwardy/opce na měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami</p> <p>Swap nebo future/forward/opce na swap, kdy si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované v různých měnách a kde jsou peněžní toky obou komponent určeny pevnými úrokovými sazbami</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS</p> <p>RTS2#16 = XXMC</p>	<p>Podkategorie měnových swapů více měn, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami, je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#13 a RTS23#42) – dvojice jmenovitých měn definovaná jako kombinace dvou měn, v nichž jsou denominovány dané dvě komponenty swapu</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ měsíc}$</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ měsíc} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ měsíce}$</p> <p>Zbytková splatnost 3: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 6 \text{ měsíců}$</p> <p>Zbytková splatnost 4: $6 \text{ měsíců} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ rok}$</p> <p>Zbytková splatnost 5: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2 \text{ roky}$</p> <p>Zbytková splatnost 6: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ roky}$</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n \text{ let}$</p>	50 000 000 EUR	10	

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity
<p>Swapy více měn na bázi OIS (OIS multi-currency swaps nebo OIS cross-currency swaps), a futures/forwardy/opce na swapy více měn na bázi OIS (overnight index swap, jednodenní indexový swap)</p> <p>Swap nebo future/forward/opce na swap, kdy si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované v různých měnách a kde jsou peněžní toky alespoň jedné z komponent určeny sazbou jednodenního indexového swapu (OIS)</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS</p> <p>RTS2#16 = OSMC</p>	<p>Podkategorie swapů více měn na bázi OIS je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#13 a RTS23#42) – dvojice jmenovitých měn definovaná jako kombinace dvou měn, v nichž jsou denominovány dané dvě komponenty swapu</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ měsíc}$</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ měsíc} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ měsíce}$</p> <p>Zbytková splatnost 3: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 6 \text{ měsíců}$</p> <p>Zbytková splatnost 4: $6 \text{ měsíců} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ rok}$</p> <p>Zbytková splatnost 5: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2 \text{ roky}$</p> <p>Zbytková splatnost 6: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ roky}$</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n \text{ let}$</p>	50 000 000 EUR	10	

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity
<p>Inflační měnové swapy více měn (inflation multi-currency swaps nebo inflation cross-currency swaps) a futures/forwardy/opce na inflační měnové swapy více měn</p> <p>Swap nebo future/forward/opce na swap, kdy si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované v různých měnách a kde jsou peněžní toky alespoň jedné z komponent určeny mírou inflace</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS</p> <p>RTS2#16 = IFMC</p>	<p>Podkategorie inflačních měnových swapů více měn je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#13 a RTS23#42) – dvojice jmenovitých měn definovaná jako kombinace dvou měn, v nichž jsou denominovány dané dvě komponenty swapu</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ měsíc}$</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ měsíc} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ měsíce}$</p> <p>Zbytková splatnost 3: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 6 \text{ měsíců}$</p> <p>Zbytková splatnost 4: $6 \text{ měsíců} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ rok}$</p> <p>Zbytková splatnost 5: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2 \text{ roky}$</p> <p>Zbytková splatnost 6: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ roky}$</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n \text{ let}$</p>	50 000 000 EUR	10	

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity
<p>Měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měny s pevnou úrokovou sazbou a měny s pohyblivou úrokovou sazbou (fixed-to-float single currency swaps), a futures/forwardy/opce na měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měny s pevnou úrokovou sazbou a měny s pohyblivou úrokovou sazbou</p> <p>Swap nebo future/forward/opce na swap, kdy si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované ve stejné měně a peněžní toky jedné komponenty jsou určeny pevnou úrokovou sazbou, zatímco toky druhé komponenty jsou určeny pohyblivou úrokovou sazbou</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS</p> <p>RTS2#16 = XFSC</p>	<p>Podkategorie měnových swapů jedné měny, kdy probíhá swap měny s pevnou úrokovou sazbou a měny s pohyblivou úrokovou sazbou, je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#13) – jmenovitá měna, v níž jsou denominovány obě komponenty swapu</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ měsíc}$</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ měsíc} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ měsíce}$</p> <p>Zbytková splatnost 3: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 6 \text{ měsíců}$</p> <p>Zbytková splatnost 4: $6 \text{ měsíců} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ rok}$</p> <p>Zbytková splatnost 5: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2 \text{ roky}$</p> <p>Zbytková splatnost 6: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ roky}$</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n \text{ let}$</p>	50 000 000 EUR	10	

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity
<p>Měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami (float-to-float single currency swaps), a futures/forwardy/opce na měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami</p> <p>Swap nebo future/forward/opce na swap, kde si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované ve stejné měně a kde jsou peněžní toky obou komponent určeny pohyblivými úrokovými sazbami</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS</p> <p>RTS2#16 = FFSC</p>	<p>Podkategorie měnových swapů jedné měny, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami, je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#13) – jmenovitá měna, v níž jsou denominovány obě komponenty swapu</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ měsíc}$</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ měsíc} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ měsíce}$</p> <p>Zbytková splatnost 3: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 6 \text{ měsíců}$</p> <p>Zbytková splatnost 4: $6 \text{ měsíců} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ rok}$</p> <p>Zbytková splatnost 5: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2 \text{ roky}$</p> <p>Zbytková splatnost 6: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ roky}$</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n \text{ let}$</p>	50 000 000 EUR	10	

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity
<p>Měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami (fixed-to-fixed single currency swaps), a futures/forwardy/opce na měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami</p> <p>Swap nebo future/forward/opce na swap, kdy si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované ve stejné měně a kde jsou peněžní toky obou komponent určeny pevnými úrokovými sazbami</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS</p> <p>RTS2#16 = XXSC</p>	<p>Podkategorie měnových swapů jedné měny, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami, je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#13) – jmenovitá měna, v níž jsou denominovány obě komponenty swapu</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc</p> <p>Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce</p> <p>Zbytková splatnost 3: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců</p> <p>Zbytková splatnost 4: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</p> <p>Zbytková splatnost 5: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</p> <p>Zbytková splatnost 6: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let</p>	50 000 000 EUR	10	

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity
<p>Swapy jedné měny na bázi OIS (OIS single currency swaps) a futures/forwardy/opce na swapy jedné měny na bázi OIS</p> <p>Swap nebo future/forward/opce na swap, kdy si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované ve stejné měně a kde jsou peněžní toky alespoň jedné z komponent určeny sazbou jednodenního indexového swapu (OIS)</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS</p> <p>RTS2#16 = OSSC</p>	<p>Podkategorie swapů jedné měny na bázi OIS je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#13) – jmenovitá měna, v níž jsou denominovány obě komponenty swapu</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ měsíc}$</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ měsíc} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ měsíce}$</p> <p>Zbytková splatnost 3: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 6 \text{ měsíců}$</p> <p>Zbytková splatnost 4: $6 \text{ měsíců} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ rok}$</p> <p>Zbytková splatnost 5: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2 \text{ roky}$</p> <p>Zbytková splatnost 6: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ roky}$</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n \text{ let}$</p>	50 000 000 EUR	10	

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity
<p>Inflační měnové swapy jedné měny (inflation single currency swaps) a futures/forwardy/opce na inflační měnové swapy jedné měny</p> <p>Swap nebo future/forward/opce na swap, kdy si dvě strany vyměňují peněžní toky denominované ve stejné měně a kde jsou peněžní toky alespoň jedné z komponent určeny mírou inflace</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP nebo FONS nebo FWOS nebo OPTS</p> <p>RTS2#16 = IFSC</p>	<p>Podkategorie inflačních měnových swapů jedné měny je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#13) – jmenovitá měna, v níž jsou denominovány obě komponenty swapu</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1$ měsíc</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ měsíc} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3$ měsíce</p> <p>Zbytková splatnost 3: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 6$ měsíců</p> <p>Zbytková splatnost 4: $6 \text{ měsíců} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1$ rok</p> <p>Zbytková splatnost 5: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2$ roky</p> <p>Zbytková splatnost 6: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3$ roky</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n$ let</p>	50 000 000 EUR	10	

Kategorie aktiv – úrokové deriváty	
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika
<p>Jiné úrokové deriváty</p> <p>Úrokový derivát, který nepatří mezi žádné z výše uvedených podkategorií aktiv</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = OTHR</p>	<p>Jakýkoli jiný úrokový derivát se považuje za nemající likvidní trh.“</p>

7) Tabulka 6.1 se nahrazuje tímto:

„Tabulka 6.1

Akciové deriváty – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – akciové deriváty

Jakákoli smlouva ve smyslu přílohy I oddílu C bodu 4 směrnice 2014/65/EU týkající se:

- jedné nebo více akcií, cenných papírů nahrazujících jiné cenné papíry, fondů obchodovaných v obchodním systému, certifikátů a jiných podobných finančních nástrojů, peněžních toků nebo jiných produktů souvisejících s výkonností jedné nebo více akcií, cenných papírů nahrazujících jiné cenné papíry, fondů obchodovaných v obchodním systému, certifikátů nebo jiných podobných finančních nástrojů;
- indexu akcií, cenných papírů nahrazujících jiné cenné papíry, fondů obchodovaných v obchodním systému, certifikátů a jiných podobných finančních nástrojů, peněžních toků nebo jiných produktů souvisejících s výkonností jedné nebo více akcií, cenných papírů nahrazujících jiné cenné papíry, fondů obchodovaných v obchodním systému, certifikátů nebo jiných podobných finančních nástrojů.

Kategorie aktiv – akciové deriváty	
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika
<p>Opce na akciové indexy</p> <p>Opce, jejímž podkladovým nástrojem je index složený z akcií</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = STIX</p> <p>RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28</p>	<p>Všechny indexové opce se považují za mající likvidní trh.</p>
<p>Futures/forwardy na akciové indexy</p> <p>Futures/forwardy, jejichž podkladovým nástrojem je index složený z akcií</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR nebo FORW</p> <p>RTS2#27 = STIX</p> <p>RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28</p>	<p>Všechny indexové futures/forwardy se považují za mající likvidní trh.</p>
<p>Akciové opce</p> <p>Opce, jejímž podkladovým nástrojem je akcie nebo koš akcií vyplývající z podnikových opatření</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = SHRS</p> <p>RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28</p>	<p>Všechny akciové opce se považují za mající likvidní trh.</p>

Kategorie aktiv – akciové deriváty	
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika
<p>Akciové futures/forwardy</p> <p>Futures/forwardy, jejichž podkladovým nástrojem je akcie nebo koš akcií vyplývající z podnikových opatření</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR nebo FORW</p> <p>RTS2#27 = SHRS</p> <p>RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28</p>	<p>Všechny akciové futures/forwardy se považují za mající likvidní trh.</p>
<p>Opce na akciové dividendy</p> <p>Opce na dividendu konkrétní akcie</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = DVSE</p> <p>RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28</p>	<p>Všechny opce na akciové dividendy se považují za mající likvidní trh.</p>
<p>Futures/forwardy na akciové dividendy</p> <p>Futures/forward na dividendu konkrétní akcie</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR nebo FORW</p> <p>RTS2#27 = DVSE</p> <p>RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28</p>	<p>Všechny futures/forwardy na akciové dividendy se považují za mající likvidní trh.</p>

Kategorie aktiv – akciové deriváty	
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika
<p>Opce na dividendový index</p> <p>Opce na dividendový index složený z dividend více než jedné akcie</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = DIVI</p> <p>RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28</p>	<p>Všechny opce na dividendový index se považují za mající likvidní trh.</p>
<p>Futures/forwardy na dividendový index</p> <p>Futures/forwardy na dividendový index složený z dividend více než jedné akcie</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR nebo FORW</p> <p>RTS2#27 = DIVI</p> <p>RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28</p>	<p>Všechny futures/forwardy na dividendový index se považují za mající likvidní trh.</p>
<p>Opce na index volatility</p> <p>Opce, jejímž podkladovým nástrojem je index volatility definovaný jako index týkající se volatility konkrétního podkladového indexu kapitálových nástrojů</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = VOLI</p> <p>RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28</p>	<p>Všechny opce na index volatility se považují za mající likvidní trh.</p>

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika
<p>Futures/forwardy na index volatility</p> <p>Futures/forwardy, jejichž podkladovým nástrojem je index volatility definovaný jako index týkající se volatility konkrétního podkladového indexu kapitálových nástrojů</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR nebo FORW</p> <p>RTS2#27 = VOLI</p> <p>RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28</p>	<p>Všechny futures/forwardy na index volatility se považují za mající likvidní trh.</p>
<p>Opce na fond obchodovaný v obchodním systému (ETF)</p> <p>Opce, jejímž podkladovým nástrojem je ETF</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = ETFS</p> <p>RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28</p>	<p>Všechny opce na fond obchodovaný v obchodním systému se považují za mající likvidní trh.</p>
<p>Futures/forwardy na fond obchodovaný v obchodním systému (ETF)</p> <p>Futures/forwardy, jejichž podkladovým nástrojem je ETF</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR nebo FORW</p> <p>RTS2#27 = ETFS</p> <p>RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28</p>	<p>Všechny futures/forwardy na fond obchodovaný v obchodním systému se považují za mající likvidní trh.</p>

Kategorie aktiv – akciové deriváty

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále segmentuje na podkategorie definované níže	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity																
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]															
Swapy RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = SWAP	Podkategorie swapů je definována následujícími kritérii pro segmentaci: Kritérium pro segmentaci 1 (RTS2#27) – druh podkladového nástroje: na jedno jméno, index, koš Kritérium pro segmentaci 2 (RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28) – podkladové jedno jméno, podkladový index, podkladový koš Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#28) – parametr: parametr výnosnosti základního vývoje (price return basic performance parameter), parametr výnosnosti dividend (parameter return dividend), parametr variance výnosnosti (parameter return variance), parametr volatility výnosnosti (parameter return volatility) Kritérium pro segmentaci 4 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:	50 000 000 EUR																
	<table border="1"> <tr> <td>Parametr výnosnosti základního vývoje</td> <td>Parametr variance/volatility výnosnosti</td> <td>Parametr výnosnosti dividend</td> </tr> <tr> <td>Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc</td> <td>Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce</td> <td>Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td> </tr> <tr> <td>Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce</td> <td>Zbytková splatnost 2: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců</td> <td>Zbytková splatnost 2: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</td> </tr> <tr> <td>Zbytková splatnost 3: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců</td> <td>Zbytková splatnost 3: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td> <td>Zbytková splatnost 3: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky</td> </tr> <tr> <td>Zbytková splatnost 4: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td> <td>Zbytková splatnost 4: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</td> <td>...</td> </tr> </table>	Parametr výnosnosti základního vývoje	Parametr variance/volatility výnosnosti	Parametr výnosnosti dividend	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce	Zbytková splatnost 2: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců	Zbytková splatnost 2: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	Zbytková splatnost 3: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců	Zbytková splatnost 3: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 3: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky	Zbytková splatnost 4: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 4: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	...		
Parametr výnosnosti základního vývoje	Parametr variance/volatility výnosnosti	Parametr výnosnosti dividend																
Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok																
Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce	Zbytková splatnost 2: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců	Zbytková splatnost 2: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky																
Zbytková splatnost 3: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců	Zbytková splatnost 3: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 3: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky																
Zbytková splatnost 4: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 4: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	...																

Kategorie aktiv – akciové deriváty					
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále segmentuje na podkategorie definované níže			Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity	
				Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	Zbytková splatnost 5: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	Zbytková splatnost 5: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let		
	Zbytková splatnost 6: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky	...			
	...	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let			
	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let				
Portfoliové swapy RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = PSWP	Podkategorie portfoliových swapů je definována touto specifickou kombinací: Kritérium pro segmentaci 1 (RTS2#27) – druh podkladového nástroje: na jedno jméno, index, koš Kritérium pro segmentaci 2 (RTS23#26 nebo při nulové hodnotě RTS23#28) – podkladové jedno jméno, podkladový index, podkladový koš Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#28) – parametr: parametr výnosnosti základního vývoje (price return basic performance parameter), parametr výnosnosti dividend (parameter return dividend), parametr variance výnosnosti (parameter return variance), parametr volatility výnosnosti (parameter return volatility) Kritérium pro segmentaci 4 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti portfoliového swapu definovaný takto: Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce Zbytková splatnost 3: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců Zbytková splatnost 4: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok Zbytková splatnost 5: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky Zbytková splatnost 6: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky ... Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let			50 000 000 EUR	15

Kategorie aktiv – akciové deriváty

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika
<p>Jiné akciové deriváty – akciový derivát, který nepatří do žádné z výše uvedených podkategorií aktiv</p> <p>RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OTHR</p>	<p>Jakýkoli jiný akciový derivát se považuje za nemající likvidní trh.“</p>

8) Tabulka 7.1 se nahrazuje tímto:

„Tabulka 7.1

Komoditní deriváty – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – komoditní deriváty				
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	
Futures/forwardy na kovové komodity RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „METL“ a [RTS2#5 = „FUTR“ nebo „FORW“]	Podkategorie futures/forwardů na kovové komodity je definována následujícími kritérii pro segmentaci: Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#36) – druh kovů: vzácné kovy, běžné kovy Kritérium pro segmentaci 2 (RTS23#37) – podkladový druh kovu Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#15) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka futures/forwardu Kritérium pro segmentaci 4 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti futures/forwardu definovaný takto:	10 000 000 EUR	10	
	Vzácné kovy			Běžné kovy
	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce			Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok
	Zbytková splatnost 2: 3 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok			Zbytková splatnost 2: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky
	Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky			Zbytková splatnost 3: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky

Kategorie aktiv – komoditní deriváty				
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.		Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.	
			Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	Zbytková splatnost 4: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky	...		
	...	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let		
	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let			
Opce na kovové komodity RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „METL“ a RTS2#5 = „OPTN“	Podkategorie opcí na kovové komodity je definována následujícími kritérii pro segmentaci: Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#36) – druh kovů: vzácné kovy, běžné kovy Kritérium pro segmentaci 2 (RTS23#37) – podkladový druh kovu Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#15) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka opce Kritérium pro segmentaci 4 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto:		10 000 000 EUR	10
	Vzácné kovy	Běžné kovy		
	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok		
	Zbytková splatnost 2: 3 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 2: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky		

Kategorie aktiv – komoditní deriváty				
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.		Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.	
			Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	Zbytková splatnost 3: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky		
	Zbytková splatnost 4: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky	...		
	...	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let		
	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let			
Swapy kovových komodit RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „METL“ a RTS2#5 = „SWAP“	Podkategorie swapů kovových komodit je definována následujícími kritérii pro segmentaci: Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#36) – druh kovů: vzácné kovy, běžné kovy Kritérium pro segmentaci 2 (RTS23#37) – podkladový druh kovu Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#15) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka swapu Kritérium pro segmentaci 4 (RTS23#34) – druh dodání definovaný jako hotovostní, ve fyzické podobě nebo volitelný Kritérium pro segmentaci 5 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:		10 000 000 EUR	10
	Vzácné kovy	Běžné kovy		
	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok		

Kategorie aktiv – komoditní deriváty				
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.		Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.	
			Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	Zbytková splatnost 2: 3 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 2: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky		
	Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	Zbytková splatnost 3: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky		
	Zbytková splatnost 4: 2 roky < čas do doby splatnosti ≤ 3 roky	...		
	...	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let		
	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let			
Futures/forwardy na energetické komodity RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „NRGY“ a [RTS2#5 = „FUTR“ nebo „FORW“]	Podkategorie futures/forwardů na energetické komodity je definována následujícími kritérii pro segmentaci: Kritérium segmentace 1 (RTS23#36) – druh energie: ropa, destiláty ropy, uhlí, lehké ropné frakce, zemní plyn, elektřina, kombinovaná energie Kritérium pro segmentaci 2 (RTS23#37) – podkladový druh energie Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#15) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka futures/forwardu Kritérium pro segmentaci 4 – [vypouští se]		10 000 000 EUR	10

Kategorie aktiv – komoditní deriváty

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.																						
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]																					
	<p>Kritérium pro segmentaci 5 (RTS2#14) – místo dodání/hotovostního vypořádání platné pro všechny druhy energie</p> <p>Kritérium pro segmentaci 6 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti futures/forwardu definovaný takto:</p>																							
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>Ropa / destiláty / lehké frakce</th> <th>Uhlí</th> <th>Zemní plyn / elektřina / kombinovaná energie</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 4 měsíce</td> <td>Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců</td> <td>Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc</td> </tr> <tr> <td>Zbytková splatnost 2: 4 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 8 měsíců</td> <td>Zbytková splatnost 2: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td> <td>Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td> </tr> <tr> <td>Zbytková splatnost 3: 8 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td> <td>Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</td> <td>Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</td> </tr> <tr> <td>Zbytková splatnost 4: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</td> <td>...</td> <td>...</td> </tr> <tr> <td>...</td> <td>Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let</td> <td>Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let</td> </tr> <tr> <td>Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let</td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>	Ropa / destiláty / lehké frakce	Uhlí	Zemní plyn / elektřina / kombinovaná energie	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 4 měsíce	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc	Zbytková splatnost 2: 4 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 8 měsíců	Zbytková splatnost 2: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 3: 8 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	Zbytková splatnost 4: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let				
Ropa / destiláty / lehké frakce	Uhlí	Zemní plyn / elektřina / kombinovaná energie																						
Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 4 měsíce	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc																						
Zbytková splatnost 2: 4 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 8 měsíců	Zbytková splatnost 2: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok																						
Zbytková splatnost 3: 8 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky																						
Zbytková splatnost 4: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky																						
...	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let																						
Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let																								

Kategorie aktiv – komoditní deriváty															
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.													
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]												
Opce na energetické komodity RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „NRGY“ a RTS2#5 = „OPTN“	Podkategorie opcí na energetické komodity je definována následujícími kritérii pro segmentaci: Kritérium segmentace 1 (RTS23#36) – druh energie: ropa, destiláty, uhlí, lehké frakce, zemní plyn, elektřina, kombinovaná energie Kritérium pro segmentaci 2 (RTS23#37) – podkladový druh energie Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#15) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka opce Kritérium pro segmentaci 4 – [vypouští se] Kritérium pro segmentaci 5 (RTS2#14) – místo dodání/hotovostního vypořádání platné pro všechny druhy energie Kritérium pro segmentaci 6 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto:	10 000 000 EUR	10												
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>Ropa / destiláty / lehké frakce</th> <th>Uhlí</th> <th>Zemní plyn / elektřina / kombinovaná energie</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 4 měsíce</td> <td>Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců</td> <td>Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc</td> </tr> <tr> <td>Zbytková splatnost 2: 4 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 8 měsíců</td> <td>Zbytková splatnost 2: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td> <td>Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td> </tr> <tr> <td>Zbytková splatnost 3: 8 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</td> <td>Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</td> <td>Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</td> </tr> </tbody> </table>			Ropa / destiláty / lehké frakce	Uhlí	Zemní plyn / elektřina / kombinovaná energie	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 4 měsíce	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc	Zbytková splatnost 2: 4 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 8 měsíců	Zbytková splatnost 2: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 3: 8 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky
	Ropa / destiláty / lehké frakce			Uhlí	Zemní plyn / elektřina / kombinovaná energie										
	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 4 měsíce			Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc										
	Zbytková splatnost 2: 4 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 8 měsíců			Zbytková splatnost 2: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok										
Zbytková splatnost 3: 8 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky													

Kategorie aktiv – komoditní deriváty					
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.			Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.	
				Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	Zbytková splatnost 4: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky		
	...	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let		
	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let				
Swapy energetických komodit RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „NRGY“ a RTS2#5 = „SWAP“	Podkategorie swapů energetických komodit je definována následujícími kritérii pro segmentaci: Kritérium segmentace 1 (RTS23#36) – druh energie: ropa, destiláty, uhlí, lehké frakce, zemní plyn, elektrina, kombinovaná energie Kritérium pro segmentaci 2 (RTS23#37) – podkladový druh energie Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#15) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka swapu Kritérium pro segmentaci 4 (RTS23#34) – druh dodání definovaný jako hotovostní, ve fyzické podobě nebo volitelný Kritérium pro segmentaci 5 – [vypouští se] Kritérium pro segmentaci 6 (RTS2#14) – místo dodání/hotovostního vypořádání platné pro všechny druhy energie Kritérium pro segmentaci 7 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:			10 000 000 EUR	10

Kategorie aktiv – komoditní deriváty					
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.			Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.	
				Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	Ropa / destiláty / lehké frakce	Uhlí	Zemní plyn / elektřina / kombinovaná energie		
	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 4 měsíce	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců	Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 1 měsíc		
	Zbytková splatnost 2: 4 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 8 měsíců	Zbytková splatnost 2: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 2: 1 měsíc < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok		
	Zbytková splatnost 3: 8 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok	Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky	Zbytková splatnost 3: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky		
	Zbytková splatnost 4: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky		
	...	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let		
	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let				
Futures/forwardy na zemědělské komodity RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „AGRI“ a [RTS2#5 = „FUTR“ nebo „FORW“]	Podkategorie futures/forwardů na zemědělské komodity je definována následujícími kritérii pro segmentaci: Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#36 a RTS23#37) – podkladová zemědělská komodita (dílčí produkt a další dílčí produkt) Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#15) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka futures/forwardu			10 000 000 EUR	10

Kategorie aktiv – komoditní deriváty			
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	<p>Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti futures/forwardu definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3$ měsíce</p> <p>Zbytková splatnost 2: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 6$ měsíců</p> <p>Zbytková splatnost 3: $6 \text{ měsíců} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1$ rok</p> <p>Zbytková splatnost 4: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2$ roky</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n$ let</p>		
<p>Opce na zemědělské komodity</p> <p>RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS2#35 = „AGRI“ a RTS2#5 = „OPTN“</p>	<p>Podkategorie opcí na zemědělské komodity je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#36 a RTS23#37) – podkladová zemědělská komodita (dílní produkt a další dílní produkt)</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#15) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka opce</p> <p>Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3$ měsíce</p> <p>Zbytková splatnost 2: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 6$ měsíců</p> <p>Zbytková splatnost 3: $6 \text{ měsíců} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1$ rok</p>	10 000 000 EUR	10

Kategorie aktiv – komoditní deriváty			
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	<p>Zbytková splatnost 4: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let</p>		
<p>Swapy zemědělských komodit</p> <p>RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „AGRI“ a RTS2#5 = „SWAP“</p>	<p>Podkategorie swapů zemědělských komodit je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#36 a RTS23#37) – podkladová zemědělská komodita (dílčí produkt a další dílčí produkt)</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#15) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka swapu</p> <p>Kritérium pro segmentaci 3 (RTS23#34) – druh dodání definovaný jako hotovostní, ve fyzické podobě nebo volitelný</p> <p>Kritérium pro segmentaci 4 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: 0 < čas do doby splatnosti ≤ 3 měsíce</p> <p>Zbytková splatnost 2: 3 měsíce < čas do doby splatnosti ≤ 6 měsíců</p> <p>Zbytková splatnost 3: 6 měsíců < čas do doby splatnosti ≤ 1 rok</p> <p>Zbytková splatnost 4: 1 rok < čas do doby splatnosti ≤ 2 roky</p>	10 000 000 EUR	10

Kategorie aktiv – komoditní deriváty			
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty.	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	... Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n \text{ let}$		
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika		
Jiné komoditní deriváty Komoditní derivát, který nepatří mezi žádné z výše uvedených podkategorií aktiv	Jakýkoli jiný komoditní derivát se považuje za nemající likvidní trh.“		

9) Tabulka 8.1 se nahrazuje tímto:

„Tabulka 8.1

Měnové deriváty – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – měnové deriváty			
Finanční nástroj týkající se měn ve smyslu přílohy I oddílu C bodu 4 směrnice 2014/65/EU			
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
<p>Nedodatelný forward (non-deliverable forward)</p> <p>Tímto forwardem se rozumí forward, v němž se protistrany vypořádají hotovostně a kde je částka vypořádání určena rozdílem směnných kurzů dvou měn mezi dnem uzavření obchodu a dnem ocenění. K datu vypořádání bude jedna strana druhé straně dlužit čistý rozdíl mezi i) směnným kurzem stanoveným ke dni uzavření obchodu a ii) směnným kurzem ke dni ocenění na základě pomyslné částky, přičemž dlužná čistá částka bude splatná v měně stanovené ve smlouvě.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = FORW</p> <p>RTS2#26 = NDLV</p>	<p>Podkategorie nedodatelných měnových forwardů (non-deliverable FX forward) je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#13 a RTS23#47) – dvojice podkladových měn definovaná jako kombinace dvou měn tvořících podkladový nástroj derivátové smlouvy</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti forwardu definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ týden}$</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ týden} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ měsíce}$</p> <p>Zbytková splatnost 3: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ rok}$</p> <p>Zbytková splatnost 4: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2 \text{ roky}$</p> <p>Zbytková splatnost 5: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ roky}$</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n \text{ let}$</p>	<p>Nedodatelné forwardy se považují za nemající likvidní trh.</p>	

Kategorie aktiv – měnové deriváty			
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
<p>Dodatelný forward (deliverable forward)</p> <p>Tímto forwardem se rozumí forward výlučně zahrnující výměnu dvou různých měn k určitému budoucímu datu vypořádání smlouvy za fixní sazbu odsouhlasenou při uzavření smlouvy pokrývající tuto výměnu.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = FORW</p> <p>RTS2#26 = DLVB</p>	<p>Podkategorie dodatelných měnových forwardů (deliverable FX forward) je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#13 a RTS23#47) – dvojice podkladových měn definovaná jako kombinace dvou měn tvořících podkladový nástroj derivátové smlouvy</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti forwardu definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ týden}$</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ týden} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ měsíce}$</p> <p>Zbytková splatnost 3: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ rok}$</p> <p>Zbytková splatnost 4: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2 \text{ roky}$</p> <p>Zbytková splatnost 5: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ roky}$</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n \text{ let}$</p>	<p>Dodatelné forwardy se považují za nemající likvidní trh.</p>	

Kategorie aktiv – měnové deriváty			
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
<p>Nedodatelné měnové opce (non-deliverable FX options)</p> <p>Těmito opcemi se rozumí opce, v nichž se protistrany vypořádají hotovostně a kde je částka vypořádání určena rozdílem směnných kurzů dvou měn mezi dnem uzavření obchodu a dnem ocenění. K datu vypořádání bude jedna strana druhé straně dlužit čistý rozdíl mezi i) směnným kurzem stanoveným ke dni uzavření obchodu a ii) směnným kurzem ke dni ocenění na základě pomyslné částky, přičemž dlužná čistá částka bude splatná v měně stanovené ve smlouvě.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#26 = NDLV</p>	<p>Podkategorie nedodatelných měnových opcí (non-deliverable FX options) je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium segmentace 1 (RTS23#13 a RTS23#47) – dvojice podkladových měn definovaná jako kombinace dvou měn tvořících podkladový nástroj derivátové smlouvy</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ týden}$</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ týden} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ měsíce}$</p> <p>Zbytková splatnost 3: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ rok}$</p> <p>Zbytková splatnost 4: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2 \text{ roky}$</p> <p>Zbytková splatnost 5: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ roky}$</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n \text{ let}$</p>	<p>Nedodatelné měnové opce se považují za nemající likvidní trh.</p>	

Kategorie aktiv – měnové deriváty			
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
<p>Dodatelné měnové opce (deliverable FX options)</p> <p>Touto opcí se rozumí opce výlučně zahrnující výměnu dvou různých měn k určitému budoucímu datu vypořádání smlouvy za fixní sazbu odsouhlasenou při uzavření smlouvy pokrývající tuto výměnu.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#26 = DLVB</p>	<p>Podkategorie dodatelných měnových opcí (deliverable FX options) je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#13 a RTS23#47) – dvojice podkladových měn definovaná jako kombinace dvou měn tvořících podkladový nástroj derivátové smlouvy</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ týden}$</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ týden} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ měsíce}$</p> <p>Zbytková splatnost 3: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ rok}$</p> <p>Zbytková splatnost 4: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2 \text{ roky}$</p> <p>Zbytková splatnost 5: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ roky}$</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n \text{ let}$</p>	<p>Dodatelné měnové opce se považují za nemající likvidní trh.</p>	

Kategorie aktiv – měnové deriváty			
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
<p>Nedodatelné měnové swapy (non-deliverable FX swaps)</p> <p>Tímto swapem se rozumí swap, v němž se protistrany vypořádají hotovostně a kde je částka vypořádání určena rozdílem směnných kurzů dvou měn mezi dnem uzavření obchodu a dnem ocenění. K datu vypořádání bude jedna strana druhé straně dlužit čistý rozdíl mezi i) směnným kurzem stanoveným ke dni uzavření obchodu a ii) směnným kurzem ke dni ocenění na základě pomyslné částky, přičemž dlužná čistá částka bude splatná v měně stanovené ve smlouvě.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = SWAP</p> <p>RTS2#26 = NDLV</p>	<p>Podkategorie nedodatelných měnových swapů (non-deliverable FX swaps) je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#13 a RTS23#47) – dvojice podkladových měn definovaná jako kombinace dvou měn tvořících podkladový nástroj derivátové smlouvy</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ týden}$</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ týden} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ měsíce}$</p> <p>Zbytková splatnost 3: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ rok}$</p> <p>Zbytková splatnost 4: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2 \text{ roky}$</p> <p>Zbytková splatnost 5: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ roky}$</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n \text{ let}$</p>	<p>Nedodatelné měnové swapy se považují za nemající likvidní trh.</p>	

Kategorie aktiv – měnové deriváty			
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
<p>Dodatelné měnové swapy (deliverable FX swaps)</p> <p>Tímto swapem se rozumí swap výlučně zahrnující výměnu dvou různých měn k určitému budoucímu datu vypořádání smlouvy za fixní sazbu odsouhlasenou při uzavření smlouvy pokrývající tuto výměnu.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = SWAP</p> <p>RTS2#26 = DLVB</p>	<p>Podkategorie dodatečných měnových swapů (deliverable FX swaps) je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#13 a RTS23#47) – dvojice podkladových měn definovaná jako kombinace dvou měn tvořících podkladový nástroj derivátové smlouvy</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ týden}$</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ týden} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ měsíce}$</p> <p>Zbytková splatnost 3: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ rok}$</p> <p>Zbytková splatnost 4: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2 \text{ roky}$</p> <p>Zbytková splatnost 5: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ roky}$</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n \text{ let}$</p>	<p>Dodatelné měnové swapy se považují za nemající likvidní trh.</p>	

Kategorie aktiv – měnové deriváty			
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
Měnové futures (FX futures) RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FUTR	Podkategorie měnových futures je definována následujícími kritérii pro segmentaci: Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#13 a RTS23#47) – dvojice podkladových měn definovaná jako kombinace dvou měn tvořících podkladový nástroj derivátové smlouvy Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti futures definovaný takto: Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ týden}$ Zbytková splatnost 2: $1 \text{ týden} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ měsíce}$ Zbytková splatnost 3: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ rok}$ Zbytková splatnost 4: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2 \text{ roky}$ Zbytková splatnost 5: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ roky}$... Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n \text{ let}$	Měnové futures se považují za nemající likvidní trh.	
Kategorie aktiv – měnové deriváty			
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika		
Jiné měnové deriváty Měnový derivát, který nepatří mezi žádné z výše uvedených podkategorií aktiv RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = OTHR	Jakýkoli jiný měnový derivát se považuje za nemající likvidní trh.“		

10) Tabulky 9.1, 9.2 a 9.3 se nahrazují tímto:

„Tabulka 9.1

Úvěrové deriváty – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – úvěrové deriváty				
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Aktuální status indexu (on-the-run status) [Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity]
<p>Swap úvěrového selhání založený na indexu – swap, u něhož je výměna peněžních toků spojena s úvěruschopností několika emitentů finančních nástrojů tvořících index a výskytem úvěrových událostí</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT</p>	<p>Podkategorie swapů úvěrového selhání založených na indexu je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS2#34) – podkladový index</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#42) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka derivátu</p> <p>Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu úvěrového selhání definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ rok}$</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2 \text{ roky}$</p> <p>Zbytková splatnost 3: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ roky}$</p> <p>...</p> <p>Zbytková splatnost m: $(n-1) \text{ let} < \text{čas do doby splatnosti} \leq n \text{ let}$</p>	200 000 000 EUR	10	<p>Podkladový index se považuje za mající likvidní trh:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) po celou dobu jeho „aktuálního“ (on-the-run) statusu 2) prvních 30 pracovních dní jeho „prvního neaktuálního statusu“ (1x off-the-run status) <p>„Aktuální“ (on-the-run) index znamená právě platnou nejnovější verzi (sérii) indexu vytvořenou k datu, kdy složení indexu nabylo účinnosti, a končící jeden den před datem, kdy nabude účinnosti složení následující verze (série) indexu.</p> <p>„Prvním neaktuálním státem“ (1x off-the-run status) se rozumí verze (série) indexu, která v určitém okamžiku bezprostředně předchází stávající aktuální (on-the-run) verzi (sérii). Verze (série) přestává být aktuální a získává svůj první neaktuální status v okamžiku, kdy je vytvořena nejnovější verze (série) indexu.</p>

Kategorie aktiv – úvěrové deriváty

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitatívni kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Aktuální status indexu (on-the-run status) [Dodatečné kvalitatívni kritérium likvidity]
<p>Swap úvěrového selhání na jedno jméno – swap, u něhož je výměna peněžních toků spojena s úvěruschopností jednoho emitenta finančních nástrojů a výskytem úvěrových událostí</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT</p>	<p>Podkategorie swapů úvěrového selhání na jedno jméno je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS2#41) – podkladový referenční subjekt</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#39) – podkladový referenční subjekt definovaný takto:</p> <p>„Veřejnoprávním a veřejným emitentem“ se rozumí subjekt emitenta, kterým je buď:</p> <ul style="list-style-type: none"> a) Unie; b) členský stát, včetně jakéhokoli ministerstva, vládní organizace nebo zvláštní účelové jednotky členského státu; c) veřejnoprávní subjekt, který není uveden v písmenech a) a b); d) v případě federativního členského státu člen federace; e) zvláštní účelová jednotka pro několik členských států; 	10 000 000 EUR	10	

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Aktuální status indexu (on-the-run status) [Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity]
	<p>f) mezinárodní finanční instituce zřízená dvěma nebo více členskými státy, jejímž účelem je získávat finanční prostředky a poskytovat finanční pomoc ve prospěch svých členů, kteří jsou postiženi nebo ohroženi vážnými finančními problémy;</p> <p>g) Evropská investiční banka;</p> <p>h) veřejný subjekt, který není veřejnoprávním emitentem, jak je uvedeno v písmenech a) až c).</p> <p>„Podnikovým emitentem“ se rozumí subjekt emitenta, který není veřejnoprávním a veřejným emitentem.</p> <p>Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#42) – jmenovitá měna definovaná jako měna, v níž je denominována pomyslná částka derivátu</p> <p>Kritérium pro segmentaci 4 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti swapu úvěrového selhání definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1 \text{ rok}$</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2 \text{ roky}$</p> <p>Zbytková splatnost 3: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3 \text{ roky}$</p>			

Kategorie aktiv – úvěrové deriváty				
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Aktuální status indexu (on-the-run status) [Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity]
	...			
	Zbytková splatnost m: $(n-1)$ let < čas do doby splatnosti $\leq n$ let			
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje následující kvalitativní kritérium likvidity		
<p>Opce na index swapů úvěrového selhání – opce, jejímž podkladovým nástrojem je index swapů úvěrového selhání</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT</p>	<p>Podkategorie opcí na index swapů úvěrového selhání je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#26) – podkategorie indexů swapů úvěrového selhání stanovená pro podkategorii swapů úvěrového selhání založených na indexu</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 6$ měsíců</p> <p>Zbytková splatnost 2: $6 \text{ měsíců} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1$ rok</p> <p>Zbytková splatnost 3: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2$ roky</p> <p>Zbytková splatnost 4: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3$ roky</p>	<p>Opce na index swapů úvěrového selhání, jejímž podkladovým indexem swapů úvěrového selhání je podkategorie určená jako mající likvidní trh a jejíž čas do doby zbytkové splatnosti je 0–6 měsíců, se považuje za mající likvidní trh.</p> <p>Opce na index swapů úvěrového selhání, jejímž podkladovým indexem swapů úvěrového selhání je podkategorie určená jako mající likvidní trh a jejíž čas do doby zbytkové splatnosti není 0–6 měsíců, se nepovažuje za mající likvidní trh.</p> <p>Opce na index swapů úvěrového selhání, jejímž podkladovým indexem swapů úvěrového selhání je podkategorie určená jako nemající likvidní trh, se pro jakýkoli čas do doby zbytkové splatnosti považuje za nemající likvidní trh.</p>		

Kategorie aktiv – úvěrové deriváty			
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	...		
	<p>Zbytková splatnost m: $(n-1)$ let < čas do doby splatnosti $\leq n$ let</p>		
<p>Opce na swap úvěrového selhání na jedno jméno – opce, jejímž podkladovým nástrojem je swap úvěrového selhání na jedno jméno</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT</p>	<p>Podkategorie opcí na swapy úvěrového selhání na jedno jméno je definována následujícími kritérii pro segmentaci:</p> <p>Kritérium pro segmentaci 1 (RTS23#26) – podkategorie swapů úvěrového selhání na jedno jméno stanovená pro tuto podkategorii aktiv</p> <p>Kritérium pro segmentaci 2 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti opce definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 6$ měsíců</p> <p>Zbytková splatnost 2: $6 \text{ měsíců} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1$ rok</p> <p>Zbytková splatnost 3: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2$ roky</p> <p>Zbytková splatnost 4: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3$ roky</p>	<p>Opce na swap úvěrového selhání na jedno jméno, jejímž podkladovým swapem úvěrového selhání na jedno jméno je podkategorie určená jako mající likvidní trh a jejíž čas do doby zbytkové splatnosti je 0–6 měsíců, se považuje za mající likvidní trh.</p> <p>Opce na swap úvěrového selhání na jedno jméno, jejímž podkladovým swapem úvěrového selhání na jedno jméno je podkategorie určená jako mající likvidní trh a jejíž čas do doby zbytkové splatnosti není 0–6 měsíců, se nepovažuje za mající likvidní trh.</p> <p>Opce na swap úvěrového selhání na jedno jméno, jejímž podkladovým swapem úvěrového selhání na jedno jméno je podkategorie určená jako nemající likvidní trh, se pro jakýkoli čas do doby zbytkové splatnosti považuje za nemající likvidní trh.</p>	

Kategorie aktiv – úvěrové deriváty				
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity. Pro podkategorie určené jako mající likvidní trh se případně použije dodatečné kvalitativní kritérium likvidity.		
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]	Aktuální status indexu (on-the-run status) [Dodatečné kvalitativní kritérium likvidity]
	...			
	Zbytková splatnost m: (n-1) let < čas do doby splatnosti ≤ n let			
Kategorie aktiv – úvěrové deriváty				
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika			
Jiné úvěrové deriváty – úvěrový derivát, který nepatří mezi žádné z výše uvedených podkategorií aktiv RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CRDT RTS2#5 = OTHR	Jakýkoli jiný úvěrový derivát se považuje za nemající likvidní trh.			

Tabulka 9.2

Úvěrové deriváty – předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI (konkrétní objem pro daný nástroj) a LIS (velký rozsah) pro podkategorie určené jako mající likvidní trh

Kategorie aktiv – úvěrové deriváty														
Podkategorie aktiv	Percentily a spodní hranice prahových hodnot, které se použijí pro výpočet předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS pro podkategorie určené jako mající likvidní trh													
	Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot	Předobchodní SSTI				Předobchodní LIS		Poobchodní SSTI			Poobchodní LIS			
		Obchod – percentil				Spodní hranice prahové hodnoty	Obchod – percentil	Spodní hranice prahové hodnoty	Obchod – percentil	Objem – percentil	Spodní hranice prahové hodnoty	Obchod – percentil	Objem – percentil	Spodní hranice prahové hodnoty
Swap úvěrového selhání založený na indexu	Výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených s finančními nástroji spadajícími do dané podkategorie	S1	S2	S3	S4	2 500 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Swap úvěrového selhání na jedno jméno	Výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených s finančními nástroji spadajícími do dané podkategorie	S1	S2	S3	S4	2 500 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									

Kategorie aktiv – úvěrové deriváty

Podkategorie aktiv	Percentily a spodní hranice prahových hodnot, které se použijí pro výpočet předobchodních a poobchodních prahových hodnot SSTI a LIS pro podkategorie určené jako mající likvidní trh													
	Obchody, které se zohlední pro výpočet prahových hodnot	Předobchodní SSTI				Předobchodní LIS		Poobchodní SSTI			Poobchodní LIS			
		Obchod – percentil				Spodní hranice prahové hodnoty	Obchod – percentil	Spodní hranice prahové hodnoty	Obchod – percentil	Objem – percentil	Spodní hranice prahové hodnoty	Obchod – percentil	Objem – percentil	Spodní hranice prahové hodnoty
Opce na index swapů úvěrového selhání	Výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených s finančními nástroji spadajícími do dané podkategorie	S1	S2	S3	S4	2 500 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Opce na swapy úvěrového selhání na jedno jméno	Výpočet prahových hodnot se provede pro každou podkategorii podkategorie aktiv týkající se obchodů provedených s finančními nástroji spadajícími do dané podkategorie	S1	S2	S3	S4	2 500 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									

Tabulka 9.3

Úvěrové deriváty – předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI (konkrétní objem pro daný nástroj) a LIS (velký rozsah) pro podkategorie určené jako nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – úvěrové deriváty				
Podkategorie aktiv	Předobchodní a poobchodní prahové hodnoty SSTI a LIS pro podkategorie určené jako nemající likvidní trh			
	Předobchodní SSTI	Předobchodní LIS	Poobchodní SSTI	Poobchodní LIS
	Prahová hodnota	Prahová hodnota	Prahová hodnota	Prahová hodnota
Swap úvěrového selhání založený na indexu	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Swap úvěrového selhání na jedno jméno	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Opce na index swapů úvěrového selhání	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Opce na swapy úvěrového selhání na jedno jméno	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Jiné úvěrové deriváty	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR“

11) Tabulka 10.1 se nahrazuje tímto:

„Tabulka 10.1

Deriváty C10 – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – deriváty C10			
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nespĺňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
Deriváty týkající se sazeb přepravného Finanční nástroj týkající se sazeb přepravného ve smyslu přílohy I oddílu C bodu 10 směrnice 2014/65/EU RTS2#3 = „DERV“ a RTS2#4 = „COMM“ a RTS23#35 = „FRGT“	Podkategorie derivátů týkajících se přepravného je definována následujícími kritérii pro segmentaci: Kritérium pro segmentaci 1 (RTS2#5) – typ smlouvy: futures nebo opce Kritérium pro segmentaci 2 (RTS23#36) – druh přepravy	10 000 000 EUR	10

Kategorie aktiv – deriváty C10			
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	<p>Kritérium pro segmentaci 3 (RTS2#37) – podtyp přepravy</p> <p>Kritérium pro segmentaci 4 (RTS2#12) – specifikace velikosti podtypu přepravy</p> <p>Kritérium pro segmentaci 5 (RTS2#13) – konkrétní trasa nebo průměr časového pronájmu</p> <p>Kritérium pro segmentaci 6 (RTS2#8) – čas do doby zbytkové splatnosti derivátu definovaný takto:</p> <p>Zbytková splatnost 1: $0 < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1$ měsíc</p> <p>Zbytková splatnost 2: $1 \text{ měsíc} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3$ měsíce</p> <p>Zbytková splatnost 3: $3 \text{ měsíce} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 6$ měsíců</p> <p>Zbytková splatnost 4: $6 \text{ měsíců} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 9$ měsíců</p> <p>Zbytková splatnost 5: $9 \text{ měsíců} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 1$ rok</p> <p>Zbytková splatnost 6: $1 \text{ rok} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 2$ roky</p> <p>Zbytková splatnost 7: $2 \text{ roky} < \text{čas do doby splatnosti} \leq 3$ roky</p>		

Kategorie aktiv – deriváty C10			
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity	
		Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
	...		
	Zbytková splatnost m : $(n-1)$ let < čas do doby splatnosti $\leq n$ let		
Kategorie aktiv – deriváty C10			
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika		
Jiné deriváty C10 Finanční nástroj ve smyslu přílohy I oddílu C bodu 10 směrnice 2014/65/EU, který není derivátem týkajícím se sazeb přepravného, jakákoli z těchto podkategorií úrokových derivátů: inflační měnový swap více měn, futures/forward na inflační měnové swapy více měn, inflační měnový swap jedné měny, futures/forward na inflační měnový swap jedné měny, a jakákoli z těchto podkategorií akciových derivátů: opce na index volatility, futures/forward na index volatility, swap s parametrem variance výnosnosti, swap s parametrem volatility výnosnosti, portfoliový swap s parametrem variance výnosnosti, portfoliový swap s parametrem volatility výnosnosti.	Jakýkoli jiný derivát C10 se považuje za nemající likvidní trh.“		

12) Tabulka 11.1 se nahrazuje tímto:

„Tabulka 11.1

Finanční rozdílové smlouvy – kategorie nemající likvidní trh

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Kvalitativní kritérium likvidity	Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
Měnové finanční rozdílové smlouvy RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = CURR	Podkategorie měnových finančních rozdílových smluv je definována dvojicí podkladových měn definovaných jako kombinace dvou měn tvořících podkladový nástroj finanční rozdílové smlouvy / smlouvy týkající se sázek na rozpětí. RTS2#30 a RTS2#31		50 000 000 EUR	100
Komoditní finanční rozdílové smlouvy RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = COMM	Podkategorie komoditních finančních rozdílových smluv je definována podkladovou komoditou finanční rozdílové smlouvy / smlouvy týkající se sázek na rozpětí. RTS23#35 a RTS23#36 a RTS23#37		50 000 000 EUR	100
Akciové finanční rozdílové smlouvy RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = EQUI	Podkategorie akciových finančních rozdílových smluv je definována podkladovými kapitálovými cennými papíry finanční rozdílové smlouvy / smlouvy týkající se sázek na rozpětí. RTS23#26	Podkategorie akciových finančních rozdílových smluv se považuje za mající likvidní trh, jsou-li podkladovým nástrojem kapitálové cenné papíry, pro které existuje likvidní trh určený v souladu s čl. 2 odst. 1 bodem 17 písm. b) nařízení (EU) č. 600/2014.		
Dluhopisové finanční rozdílové smlouvy RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = BOND	Podkategorie dluhopisových finančních rozdílových smluv je definována podkladovým dluhopisem nebo dluhopisovým futures finanční rozdílové smlouvy / smlouvy týkající se sázek na rozpětí. RTS23#26	Podkategorie dluhopisových finančních rozdílových smluv se považuje za mající likvidní trh, je-li podkladovým nástrojem dluhopis nebo dluhopisový futures, pro který existuje likvidní trh určený v souladu s článkem 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b).		

Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se každá podkategorie aktiv dále člení na podkategorie definované níže.	Kvalitativní kritérium likvidity	Průměrná denní pomyslná částka (ADNA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
Finanční rozdílové smlouvy týkající se akciových futures/forwardů RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = FTEQ	Podkategorie finančních rozdílových smluv týkajících se akciových futures/forwardů je definována podkladovými akciovými futures/forwardy finanční rozdílové smlouvy / smlouvy týkající se sázek na rozpětí. RTS23#26	Podkategorie finančních rozdílových smluv týkajících se akciových futures/forwardů se považuje za mající likvidní trh, jsou-li podkladovým nástrojem akciové futures/forwardy, pro které existuje likvidní trh určený v souladu s článkem 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b).		
Rozdílové finanční smlouvy týkající se opce na akcie RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OPEQ	Podkategorie finančních rozdílových smluv týkajících se opce na akcie je definována podkladovou opcí na akcie finanční rozdílové smlouvy / smlouvy týkající se sázek na rozpětí. RTS23#26	Podkategorie finančních rozdílových smluv týkajících se akciových opcí se považuje za mající likvidní trh, je-li podkladovým nástrojem akciová opce, pro kterou existuje likvidní trh určený v souladu s článkem 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b).		
Kategorie aktiv – finanční rozdílové smlouvy				
Podkategorie aktiv	Pro účely určení kategorií finančních nástrojů považovaných za nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b) se použije následující metodika			
Jiné finanční rozdílové smlouvy				
Finanční rozdílová smlouva / sázka na rozpětí, které nepatří mezi žádné z výše uvedených podkategorií aktiv RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OTHR	Jakákoli jiná finanční rozdílová smlouva / sázka na rozpětí se považuje za nemající likvidní trh.“			

13) Tabulka 12.1 se nahrazuje tímto:

„Tabulka 12.1

Povolenky na emise – kategorie nemající likvidní trh

Kategorie aktiv – povolenky na emise		
Podkategorie aktiv	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nespĺňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity	
	Průměrná denní částka (ADA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
<p>Povolenky na emise (EUA)</p> <p>Jakýkoli nástroj, který se považuje za nástroj splňující požadavky směrnice Evropského parlamentu a Rady 2003/87/ES ⁽¹⁾ (1) (systém obchodování s emisemi) a který představuje právo vypustit ekvivalent jedné tuny ekvivalentu oxidu uhličitého (tCO₂e)</p> <p>RTS2#3 = EMAL a RTS2#11 = EUAE</p>	150 000 tun ekvivalentu oxidu uhličitého	5
<p>Povolenky pro letectví (EUAA)</p> <p>Jakýkoli nástroj, který se považuje za nástroj splňující požadavky směrnice 2003/87/ES (systém obchodování s emisemi) a který představuje právo vypustit ekvivalent jedné tuny ekvivalentu oxidu uhličitého (tCO₂e) v oblasti letectví</p> <p>RTS2#3 = EMAL a RTS2#11 = EUAA</p>	150 000 tun ekvivalentu oxidu uhličitého	5
<p>Ověřená snížení emisí (CER)</p> <p>Jakýkoli nástroj, který se považuje za nástroj splňující požadavky směrnice 2003/87/ES (systém obchodování s emisemi) a který představuje snížení emisí rovnající se jedné tuně ekvivalentu oxidu uhličitého (tCO₂e)</p> <p>RTS2#3 = EMAL a RTS2#11 = CERE</p>	150 000 tun ekvivalentu oxidu uhličitého	5

Kategorie aktiv – povolenky na emise		
Podkategorie aktiv	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity	
	Průměrná denní částka (ADA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
<p>Jednotky snížení emisí (ERU)</p> <p>Jakýkoli nástroj, který se považuje za nástroj splňující požadavky směrnice 2003/87/ES (systém obchodování s emisemi) a který představuje snížení emisí rovnající se jedné tuně ekvivalentu oxidu uhličitého (tCO₂e)</p> <p>RTS2#3 = EMAL a RTS2#11 = ERUE</p>	150 000 tun ekvivalentu oxidu uhličitého	5
<p>Jiné povolenky na emise</p> <p>Povolenka na emise, která se považuje za povolenku na emise splňující požadavky směrnice 2003/87/ES (systém obchodování s emisemi) a není povolenkou na emise EU (EUA), povolenkou pro letectví (EUAA), ověřeným snížením emisí (CER), ani jednotkou snížení emisí (ERU).</p> <p>RTS2#3 = EMAL a RTS2#11 = OTHR</p>	Jakékoli jiné povolenky na emise se považují za nemající likvidní trh.	

(¹) Směrnice Evropského parlamentu a Rady 2003/87/ES ze dne 13. října 2003 o vytvoření systému pro obchodování s povolenkami na emise skleníkových plynů v Unii a o změně směrnice Rady 96/61/ES (Úř. věst. L 275, 25.10.2003, s. 32).*

14) Tabulka 13.1 se nahrazuje tímto:

„Tabulka 13.1

Deriváty povolenek na emise – kategorie nemající likvidní trh

Podkategorie aktiv	Kategorie aktiv – deriváty povolenek na emise	
	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity	
	Průměrná denní částka (ADA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
<p>Deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou povolenky na emise (EUA)</p> <p>Finanční nástroj týkající se povolenek na emise typu povolenky na emise (EUA) ve smyslu přílohy I oddílu C bodu 4 směrnice 2014/65/EU</p> <p>RTS2#3 = DERV a RTS2#4 = EMAL a RTS2#43 = EUAE</p>	150 000 tun ekvivalentu oxidu uhličitého	5
<p>Deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou povolenky pro letectví (EUAA)</p> <p>Finanční nástroj týkající se povolenek na emise typu povolenky pro letectví (EUAA) ve smyslu přílohy I oddílu C bodu 4 směrnice 2014/65/EU</p> <p>RTS2#3 = DERV a RTS2#4 = EMAL a RTS2#43 = EUAA</p>	150 000 tun ekvivalentu oxidu uhličitého	5
<p>Deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou ověřená snížení emisí (CER)</p> <p>Finanční nástroj týkající se povolenek na emise typu ověřeného snížení emisí (CER) ve smyslu přílohy I oddílu C bodu 4 směrnice 2014/65/EU</p> <p>RTS2#3 = DERV a RTS2#4 = EMAL a RTS2#43 = CERE</p>	150 000 tun ekvivalentu oxidu uhličitého	5

Kategorie aktiv – deriváty povolenek na emise		
Podkategorie aktiv	Každá podkategorie se určí jako nemající likvidní trh podle článku 6 a čl. 8 odst. 1 písm. b), pokud nesplňuje jednu nebo všechny následující prahové hodnoty kvantitativních kritérií likvidity	
	Průměrná denní částka (ADA) [kvantitativní kritérium likvidity 1]	Průměrný denní počet obchodů [kvantitativní kritérium likvidity 2]
<p>Deriváty povolenek na emise, jejichž podkladovým nástrojem jsou jednotky snížení emisí (ERU)</p> <p>Finanční nástroj týkající se povolenek na emise typu jednotky snížení emisí (ERU) ve smyslu přílohy I oddílu C bodu 4 směrnice 2014/65/EU</p> <p>RTS2#3 = DERV a RTS2#4 = EMAL a RTS2#43 = ERUE</p>	150 000 tun ekvivalentu oxidu uhličitého	5
<p>Jiné deriváty povolenek na emise</p> <p>Derivát povolenek na emise, jehož podkladovým nástrojem je povolenka na emise, která se považuje za povolenku na emise splňující požadavky směrnice 2003/87/ES (systém obchodování s emisemi) a která není povolenkou na emise EU (EUA), povolenkou pro letectví (EUAA), ověřeným snížením emisí (CER), ani jednotkou snížení emisí (ERU)</p> <p>RTS2#3 = DERV a RTS2#4 = EMAL a RTS2#43 = OTHR</p>	Jakýkoli jiný derivát povolenek na emise se považuje za nemající likvidní trh.“	

PŘÍLOHA IV

V příloze IV se tabulky 1 a 2 nahrazují tímto:

„Tabulka 1

Tabulka symbolů pro tabulku 2

SYMBOL	TYP DAT	DEFINICE
{ALPHANUM-n}	Až n alfanumerických znaků	Volný text
{DECIMAL-n/m}	Celkem až n-místné desetinné číslo, z čehož až m míst může být zlomková část	Numerické pole pro kladné i záporné hodnoty: — desetinný oddělovač je „.“ (tečka), — před číslem může být znaménko „-“ (minus) pro označení záporných čísel. Hodnoty se případně zaokrouhlují, nikoli zkracují.
{COUNTRYCODE_2}	2 alfanumerické znaky	Kód země ze dvou písmen podle kódu země ISO 3166-1 alpha-2
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerické znaky	Kód měny ze tří písmen podle kódů měn ISO 4217
{DATEFORMAT}	Formát data podle ISO 8601	Formátování dat: RRRR-MM-DD
{ISIN}	12 alfanumerických znaků	Kód ISIN ve smyslu normy ISO 6166
{LEI}	20 alfanumerických znaků	Identifikátor právnické osoby ve smyslu normy ISO 17442
{MIC}	4 alfanumerické znaky	Identifikační kód trhu ve smyslu normy ISO 10383
{EIC}	16 alfanumerických znaků	Kód EIC vztahující se k místu dodání v Evropské unii nebo mimo ni
{INDEX}	4 alfabetské znaky	„EONA“ – EONIA „EONS“ – EONIA SWAP „EURI“ – EURIBOR „EUUS“ – EURODOLLAR „EUCH“ – EuroSwiss „GCFR“ – GCF REPO „ISDA“ – ISDAFIX „LIBI“ – LIBID „LIBO“ – LIBOR

SYMBOL	TYP DAT	DEFINICE
		„MAAA“ – Muni AAA „PFAN“ – Pfandbriefe „TIBO“ – TIBOR „STBO“ – STIBOR „BBSW“ – BBSW „JIBA“ – JIBAR „BUBO“ – BUBOR „CDOR“ – CDOR „CIBO“ – CIBOR

Tabulka 2

Podrobnosti o referenčních údajích, které mají být poskytnuty pro účely výpočtů transparentnosti

Č.	POLE	PODROBNOSTI, KTERÉ SE MAJÍ VYKAZOVAT	FORMÁT PRO PODÁVÁNÍ ZPRÁV
1	Identifikační kód nástroje	Kód k identifikaci finančního nástroje	{ISIN}
2	Úplný název nástroje	Úplný název finančního nástroje	{ALPHANUM-350}
3	Identifikační kód MiFIR	<p>Identifikace nekapitálových finančních nástrojů:</p> <p>Sekuritizované deriváty ve smyslu tabulky 4.1 v oddíle 4 přílohy III</p> <p>Strukturované finanční produkty ve smyslu čl. 2 odst. 1 bodu 28 nařízení (EU) č. 600/2014</p> <p>Dluhopisy (pro všechny dluhopisy s výjimkou ETC a ETN) ve smyslu čl. 4 odst. 1 bodu 44 písm. b) směrnice 2014/65/EU</p> <p>ETC ve smyslu čl. 4 odst. 1 bodu 44 písm. b) směrnice 2014/65/EU a dalšího upřesnění v tabulce 2.4 oddílu 2 přílohy III</p> <p>ETN ve smyslu čl. 4 odst. 1 bodu 44 písm. b) směrnice 2014/65/EU a dalšího upřesnění v tabulce 2.4 oddílu 2 přílohy III</p>	<p>Nekapitálové finanční nástroje:</p> <p>„SDRV“ – sekuritizované deriváty</p> <p>„SFPS“ – strukturované finanční produkty</p> <p>„BOND“ – dluhopisy</p> <p>„ETCS“ – ETC</p> <p>„ETNS“ – ETN</p> <p>„EMAL“ – povolenky na emise</p> <p>„DERV“ – deriváty</p>

Č.	POLE	PODROBNOSTI, KTERÉ SE MAJÍ VYKAZOVAT	FORMÁT PRO PODÁVÁNÍ ZPRÁV
		<p>Povolenky na emise ve smyslu tabulky 12.1 oddílu 12 přílohy III</p> <p>Deriváty ve smyslu přílohy I oddílu C bodů 4 až 10 směrnice 2014/65/EU</p>	
4	Kategorie aktiv podkladového nástroje	Vyplní se, je-li identifikační kód MiFIR sekuritizovaný derivát nebo derivát.	<p>„INTR“ – úroková sazba</p> <p>„EQUI“ – kapitál</p> <p>„COMM“ – komodity</p> <p>„CRDT“ – úvěr</p> <p>„CURR“ – měna</p> <p>„EMAL“ – povolenky na emise</p> <p>„OCTN“ – jiné C10</p>
5	Typ smlouvy	Vyplní se, je-li identifikační kód MiFIR derivát.	<p>„OPTN“ – opce</p> <p>„FUTR“ – futures (včetně dohod o sazbách přepravného (FFA))</p> <p>„FRAS“ – dohoda o forwardových úrokových mírách (FRA)</p> <p>„FORW“ – forwardy</p> <p>„SWAP“ – swapy</p> <p>„PSWP“ – portfoliové swapy</p> <p>„SWPT“ – swapce</p> <p>„OPTS“ – opce na swapy</p> <p>„FONS“ – futures na swapy</p> <p>„FWOS“ – forwardy na swapy</p> <p>„SPDB“ – sázky na rozpětí</p> <p>„CFDS“ – finanční rozdílové smlouvy</p> <p>„OTHR“ – jiné</p>
6	Den vykazování	Den, pro který jsou poskytnuty referenční údaje	{DATEFORMAT}

Č.	POLE	PODROBNOSTI, KTERÉ SE MAJÍ VYKAZOVAT	FORMÁT PRO PODÁVÁNÍ ZPRÁV
7	Obchodní systém	MIC segmentu obchodního systému, existuje-li, jinak operační MIC.	{MIC}
8	Splatnost	Definovaná splatnost finančního nástroje. Pole se použije pro tyto kategorie aktiv: dluhopisy, úrokové deriváty, akciové deriváty, komoditní deriváty, měnové deriváty, úvěrové deriváty, deriváty C10 a deriváty povolenek na emise.	{DATEFORMAT}

Pole týkající se dluhopisů (všech druhů dluhopisů s výjimkou ETC a ETN)

Pole v tomto oddíle se vyplňují pouze pro dluhopisy ve smyslu tabulky 2.1 v oddíle 2 přílohy III

9	Druh dluhopisu	Druh dluhopisu ve smyslu tabulky 2.2 oddílu 2 přílohy III. Vyplní se, pouze je-li identifikační kód MiFIR dluhopis.	„EUSB“ – státní dluhopisy „OEPB“ – jiné veřejné dluhopisy „CVTB“ – konvertibilní dluhopisy „CVDB“ – kryté dluhopisy „CRPB“ – podnikové dluhopisy „OTHR“ – jiné
10	Datum emise	Datum, kdy je dluhopis emitován a začne nabíhat úrok.	{DATEFORMAT}

Pole týkající se povolenek na emise

Pole v tomto oddíle se vyplňují pouze pro povolenky na emise ve smyslu tabulky 12.1 v oddíle 12 přílohy III

11	Podtyp povolenek na emise	Povolenky na emise	„CERE“ – CER „ERUE“ – ERU „EUAE“ – EUA „EUAA“ – EUAA „OTHR“ – jiné
----	---------------------------	--------------------	--

Pole týkající se derivátů**Komoditní deriváty a deriváty C10**

Pole v tomto oddíle se vyplňují pouze pro komoditní deriváty ve smyslu tabulky 7.1 oddílu 7 přílohy III a pro deriváty C10 ve smyslu tabulky 10.1 oddílu 10 přílohy III

12	Specifikace velikosti podtypu přepravy	Vyplní se, je-li jako základní produkt uvedený v tabulce 2 poli 35 přílohy nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/585 uvedena přeprava.	<p>Pro přepravu po souši:</p> <p>„CAPE“ – Capesize</p> <p>„PNMX“ – Panamax</p> <p>„SPMX“ – Supramax</p> <p>„HAND“ – Handysize</p> <p>Pro přepravu po vodě:</p> <p>„CLAN“ – čistá</p> <p>„DRTY“ – hrubá</p> <p>{ALPHANUM-4} jinak</p>
13	Konkrétní trasa nebo průměr časového pronájmu	Vyplní se, je-li jako základní produkt uvedený v tabulce 2 poli 35 přílohy nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/585 uvedena přeprava.	<p>Pro přepravu po vodě:</p> <p>„TD7“ – TD7</p> <p>„TD8“ – TD8</p> <p>„TD17“ – TD17</p> <p>„TD19“ – TD19</p> <p>„TD20“ – TD20</p> <p>„BLPG1“ – BLPG1</p> <p>„TD3C“ – TD3C</p> <p>„TC2“ – TC2</p> <p>„TC2_37“ – TC2_37</p> <p>„TD3“ – TD3</p> <p>„TC5“ – TC5</p> <p>„TC6“ – TC6</p> <p>„TC7“ – TC7</p> <p>„TC9“ – TC9</p> <p>„TC12“ – TC12</p> <p>„TC14“ – TC14</p> <p>„TC15“ – TC15</p>

			Pro přepravu po souši: „4TC“ – 4TC „5TC“ – 5TC „6TC“ – 6TC „10TC“ – 10TC „C3“ – C3 „C5“ – C5 „C7“ – C7 „P1A“ – P1A „P2A“ – P2A „P3A“ – P3A „P1E“ – P1E „P2E“ – P2E „P3E“ – P3E {ALPHANUM-6} jinak
14	Místo dodání/hotovostního vypořádání	Vyplní se, je-li jako základní produkt uvedený v tabulce 2 poli 35 přílohy nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2017/585 uvedena energie.	{EIC} pro elektřinu nebo zemní plyn „OTHR“ – jiné
15	Jmenovitá měna	Měna, v níž je denominována jmenovitá částka.	{CURRENCYCODE_3}

Úrokové deriváty

Pole v tomto oddíle se vyplňují pouze pro úrokové deriváty ve smyslu přílohy III oddílu 5 tabulky 5.1

16	Druh podkladového nástroje	<p>Vyplní se pro typ smlouvy jiný než swapy, swapce, futures na swapy a forwardy na swapy, a to jednou z následujících možností</p> <p>***** ****</p> <p>Vyplní se pro typ smlouvy swapy, swapce, opce na swapy, futures na swapy a forwardy na swapy, a to s ohledem na podkladový swap jednou z následujících možností</p>	<p>„BOND“ – dluhopisy</p> <p>„BNDF“ – dluhopisové futures „INTR“ – úroková sazba</p> <p>„IFUT“ – úrokové futures</p> <p>***** **</p> <p>„FFMC“ – měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami (float-to-float multi-currency swaps)</p>
----	----------------------------	--	--

			<p>„XFMC“ – měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měny s pevnou úrokovou sazbou a měny s pohyblivou úrokovou sazbou (fixed-to-float multi-currency swaps)</p> <p>„XXMC“ – měnové swapy více měn, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami (fixed-to-fixed multi-currency swaps)</p> <p>„OSMC“ – swapy více měn na bázi OIS (OIS multi-currency swaps)</p> <p>„IFMC“ – inflační měnové swapy více měn (inflation multi-currency swaps)</p> <p>„FFSC“ – měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pohyblivými úrokovými sazbami (float-to-float single-currency swaps)</p> <p>„XFSC“ – měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měny s pevnou úrokovou sazbou a měny s pohyblivou úrokovou sazbou (fixed-to-float single-currency swaps)</p> <p>„XXSC“ – měnové swapy jedné měny, kdy probíhá swap měn s pevnými úrokovými sazbami (fixed-to-fixed single-currency swaps)</p> <p>„OSSC“ – swapy jedné měny na bázi OIS (OIS single-currency swaps)</p> <p>„IFSC“ – inflační měnové swapy jedné měny (inflation single-currency swaps)</p>
17	Emitent podkladového dluhopisu	Je-li podkladovým nástrojem dluhopis nebo dluhopisové future, vyplní se kódem identifikátoru právnické osoby (LEI) emitenta přímého nebo hlavního podkladového dluhopisu.	{LEI}
18	Datum splatnosti podkladového dluhopisu	Vyplní se datem definované splatnosti podkladového dluhopisu.	{DATEFORMAT}
19	Datum emise podkladového dluhopisu	Vyplní se datem emise podkladového dluhopisu.	{DATEFORMAT}
20	Jmenovitá měna swapce	Vyplní se pouze pro swapce	{CURRENCYCODE_3}
21	Splatnost podkladového swapu	Vyplní se pouze pro swapce, opce na swapy, futures na swapy a forwardy na swapy	{DATEFORMAT}

22	Kód ISIN indexu inflace / kód ISIN podkladového dluhopisu	<p>V případě swapcí týkajících se jednoho z následujících druhů podkladových swapů: inflační měnový swap jedné měny, futures/forwardy na inflační měnový swap jedné měny, inflační měnový swap více měn, futures/forwardy na inflační měnový swap více měn; má-li index inflace ISIN, vyplní se pole kódem ISIN pro daný index.</p> <p>***** ***</p> <p>V případě dluhopisových opcí / opcí na dluhopisovou opci / opcí na dluhopisový futures musí být v poli vyplněn kód ISIN hlavního podkladového dluhopisu.</p>	<p>{ISIN}</p> <p>*****</p> <p>{ISIN}</p>
23	Název indexu inflace	<p>V případě swapcí týkajících se jednoho z následujících druhů podkladových swapů se pole vyplní standardizovaným názvem indexu: inflační měnový swap jedné měny, futures/forwardy na inflační měnový swap jedné měny, inflační měnový swap více měn, futures/forwardy na inflační měnový swap více měn.</p>	{ALPHANUM-25}
24	Referenční sazba	Název referenční sazby.	<p>{INDEX}</p> <p>nebo</p> <p>{ALPHANUM-25} – pokud není referenční sazba zahrnuta do seznamu {INDEX}</p>
25	Doba trvání podkladové úrokové sazby	<p>V tomto poli se uvádí doba trvání úrokové sazby, která je podkladem smlouvy. Doba se vyjádří v dnech, týdnech, měsících nebo letech.</p> <p>Začíná se od největší jednotky doby trvání (roky) a postupuje se směrem dolů; pokud je doba trvání úrokové sazby celým číslem, je tato standardní doba trvání vyplněna v tomto poli.</p>	<p>{INTEGER-3}+„DAYS“ – dny</p> <p>{INTEGER-3}+„WEEK“ – týdny</p> <p>{INTEGER-3}+„MNTH“ – měsíce</p> <p>{INTEGER-3}+„YEAR“ – roky</p>

Měnové deriváty

Pole v tomto oddíle se vyplňují pouze pro měnové deriváty ve smyslu tabulky 8.1 oddílu 8 přílohy III

26	Podtyp smlouvy	Vyplní se tak, aby se odlišily dodatečné a nedodatečné forwardy, opce a swapy, jak jsou uvedeny v tabulce 8.1 oddílu 8 přílohy III.	„DLVR“ – dodatečný (deliverable) „NDLV“ – nedodatečný (non-deliverable)
----	----------------	---	--

Akciové deriváty

Pole v tomto oddíle se vyplňují pouze pro akciové deriváty ve smyslu tabulky 6.1 oddílu 6 přílohy III

27	Druh podkladového nástroje	<p>Vyplní se, je-li identifikačním kódem MiFIR derivát, kategorií aktiv podkladového nástroje akcie a podkategorií aktiv nejsou ani swapy, ani portfoliové swapy.</p> <p>*****</p> <p>Vyplní se, je-li identifikačním kódem MiFIR derivát, kategorií aktiv podkladového nástroje akcie a podkategorií aktiv jsou buď swapy, nebo portfoliové swapy a kritériem pro segmentaci 2 ve smyslu tabulky 6.1 oddílu 6 přílohy III je jedno jméno.</p>	<p>„STIX“ – akciový index</p> <p>„SHRS“ – akcie</p> <p>„DIVI“ – dividendový index</p> <p>„DVSE“ – akciová dividendy</p> <p>„BSKT“ – koš akcií vyplývajících z podnikových opatření</p> <p>„ETFS“ – fondy obchodované v obchodním systému</p> <p>„VOLI“ – index volatility</p> <p>„OTHR“ – jiné (včetně cenných papírů nahrazujících jiné cenné papíry, certifikátů a jiných finančních nástrojů podobných kapitálovým)</p> <p>*****</p> <p>„SHRS“ – akcie</p> <p>„DVSE“ – akciová dividendy</p> <p>„ETFS“ – fondy obchodované v obchodním systému</p> <p>„OTHR“ – jiné (včetně cenných papírů nahrazujících jiné cenné papíry, certifikátů a jiných finančních nástrojů podobných kapitálovým)</p>
----	----------------------------	--	--

		<p>*****</p> <p>Vyplní se, je-li identifikačním kódem MiFIR derivát, kategorií aktiv podkladového nástroje akcie a podkategorií aktiv jsou buď swapy, nebo portfoliové swapy a kritériem pro segmentaci 2 ve smyslu tabulky 6.1 oddílu 6 přílohy III je index.</p> <p>*****</p> <p>Vyplní se, je-li identifikačním kódem MiFIR derivát, kategorií aktiv podkladového nástroje akcie a podkategorií aktiv jsou buď swapy, nebo portfoliové swapy a kritériem pro segmentaci 2 ve smyslu tabulky 6.1 oddílu 6 přílohy III je koš.</p>	<p>*****</p> <p>„STIX“ – akciový index</p> <p>„DIVI“ – dividendový index</p> <p>„VOLI“ – index volatility</p> <p>„OTHR“ – jiné</p> <p>*****</p> <p>„BSKT“ – koš</p>
28	Parametr	Vyplní se, je-li identifikačním kódem MiFIR derivát, kategorií aktiv podkladového nástroje akcie a podkategorií aktiv jedna z následujících možností: swapy, portfoliové swapy.	<p>„PRBP“ – parametr výnosnosti základního vývoje</p> <p>„PRDV“ – parametr výnosnosti dividend</p> <p>„PRVA“ – parametr variance výnosnosti</p> <p>„PRVO“ – parametr volatility výnosnosti</p>

Finanční rozdílové smlouvy

Tato pole se vyplní, pouze je-li typem smlouvy rozdílová smlouva nebo sázka na rozpětí.

29	Druh podkladového nástroje	Vyplní se, je-li identifikačním kódem MiFIR derivát a typem smlouvy rozdílová smlouva nebo sázka na rozpětí.	<p>„CURR“ – měna</p> <p>„EQUI“ – kapitál</p> <p>„BOND“ – dluhopisy</p> <p>„FTEQ“ – akciové futures/forwardy</p> <p>„OPEQ“ – opce na akcie</p> <p>„COMM“ – komodita</p> <p>„EMAL“ – povolenky na emise</p> <p>„OTHR“ – jiné</p>
----	----------------------------	--	--

30	Jmenovitá měna 1	První měna podkladové dvojice měn. Pole se použije, je-li druhem podkladového nástroje měna.	{CURRENCYCODE_3}
31	Jmenovitá měna 2	Druhá měna podkladové dvojice měn. Pole se použije, je-li druhem podkladového nástroje měna.	{CURRENCYCODE_3}

Úvěrové deriváty

Pole v tomto oddíle se vyplňují pouze pro úvěrové deriváty ve smyslu tabulky 9.1 oddílu 9 přílohy III

32	Kód ISIN podkladového swapu úvěrového selhání	Vyplní se pro deriváty na swapy úvěrového selhání, a to kódem ISIN podkladového swapu.	{ISIN}
33	Kód podkladového indexu	Vyplní se pro deriváty na index swapů úvěrového selhání, a to kódem ISIN indexu.	{ISIN}
34	Název podkladového indexu	Vyplní se pro deriváty na index swapů úvěrového selhání, a to standardizovaným názvem indexu.	{ALPHANUM-25}
35	Série	Případně číslo série složení indexu. Vyplní se pro index swapů úvěrového selhání nebo pro derivát na index swapů úvěrového selhání, a to číslem série tohoto indexu.	{DECIMAL-18/17}
36	Verze	Nová verze série se vydá, pokud jedna ze složek selže a index musí být nově vyvážen, aby se zohlednil nový celkový počet složek indexu. Vyplní se pro index swapů úvěrového selhání nebo pro derivát na index swapů úvěrového selhání, a to uvedením verze tohoto indexu.	{DECIMAL-18/17}
37	Měsíce rolování indexu (roll months)	Všechny měsíce, kdy se očekává rolování indexu, jak bylo stanoveno poskytovatelem indexu pro daný rok. Pole se zopakuje pro každý měsíc rolování. Vyplní se pro index swapů úvěrového selhání nebo pro derivát na index swapů úvěrového selhání.	„01“, „02“, „03“, „04“, „05“, „06“, „07“, „08“, „09“, „10“, „11“, „12“
38	Datum příštího rolování (next roll date)	Vyplní se pro index swapů úvěrového selhání nebo pro derivát na index swapů úvěrového selhání, a to datem příštího rolování, jak bylo stanoveno poskytovatelem indexu.	{DATEFORMAT}

39	Veřejnoprávní a veřejný emitent	Vyplní se, je-li referenčním subjektem swapu úvěrového selhání na jedno jméno nebo derivátu na swap úvěrového selhání na jedno jméno veřejnoprávní emitent ve smyslu tabulky 9.1 oddílu 9 přílohy III.	„TRUE“ – referenčním subjektem je veřejnoprávní a veřejný emitent „FALSE“ – referenčním subjektem není veřejnoprávní a veřejný emitent“
40	Referenční závazek	Vyplní se pro derivát na swap úvěrového selhání na jedno jméno, a to kódem ISIN referenčního závazku.	{ISIN}
41	Referenční subjekt	Vyplní se referenčním subjektem swapu úvěrového selhání na jedno jméno nebo derivátu na swap úvěrového selhání na jedno jméno.	{COUNTRYCODE_2} nebo ISO 3166-2 – kód země ze 2 znaků následovaný pomlčkou „-“ a kódem nižší územní jednotky až ze 3 alfanumerických znaků nebo {LEI}
42	Jmenovitá měna	Měna, v níž je denominována jmenovitá částka.	{CURRENCYCODE_3}

Deriváty povolenek na emise

Pole v tomto oddíle se vyplňují pouze pro deriváty povolenek na emise ve smyslu tabulky 13.1 oddílu 13 přílohy III

43	Podtyp derivátu povolenek na emise	Vyplní se, je-li proměnná #3 „identifikační kód MiFIR“ „DERV“ – derivát a proměnná #4 „kategorie aktiv podkladového nástroje“ je „EMAL“ – povolenky na emise.	„CERE“ – CER „ERUE“ – ERU „EUAE“ – EUA „EUAA“ – EUAA „OTHR“ – jiné“
----	------------------------------------	---	---

PŘÍLOHA V

„PŘÍLOHA V

Kvantitativní údaje, které mají být poskytnuty pro účely výpočtů transparentnosti

Tabulka 1

Tabulka symbolů pro tabulku 2

Symbol	Druh údajů	Definice
{ALPHANUM-n}	Až n alfanumerických znaků	Volný text
{ISIN}	12 alfanumerických znaků	Kód ISIN ve smyslu normy ISO 6166
{MIC}	4 alfanumerické znaky	Identifikační kód trhu ve smyslu normy ISO 10383
{DATEFORMAT}	Formát data podle ISO 8601	Formátování dat: RRRR-MM-DD
{DECIMAL-n/m}	Celkem až n-místné desetinné číslo, z čehož až m míst může být zlomková část	Numerické pole pro kladné i záporné hodnoty. Desetinný oddělovač je „.“ (tečka), před zápornými čísly je znaménko „-“ (minus); hodnoty se zaokrouhlují a nezkracují.
{INTEGER-n}	Až n-místné celé číslo	Numerické pole pro kladné i záporné celé hodnoty.

Tabulka 2

Podrobnosti o údajích, které mají být poskytnuty pro účely určení likvidního trhu a prahových hodnot LIS (velký rozsah) a SSTI (konkrétní objem pro daný nástroj) pro nekapitálové finanční nástroje

Č.	Pole	Podrobnosti, které se mají vykazovat	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát a normy pro oznamování
1	Identifikační kód nástroje	Kód k identifikaci finančního nástroje	Regulovaný trh (RM) Mnohostranný obchodní systém (MTF) Organizovaný obchodní systém (OTF) Schválený systém pro uveřejňování informací (APA) Poskytovatel konsolidovaných obchodních informací (CTP)	{ISIN}

Č.	Pole	Podrobnosti, které se mají vykazovat	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát a normy pro oznamování
2	Datum provedení	Datum provedení obchodů.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DATEFORMAT}
3	Místo provedení	MIC segmentu obchodního systému EU nebo systematického internalizátora, je-li k dispozici, v opačném případě operační MIC. MIC segmentu systematického internalizátora, existuje-li, jinak operační MIC. Kód MIC XOFF pro mimoburzovní obchody. Pro daný ISIN a datum provedení shrnou schválené systémy pro uveřejňování informací všechny mimoburzovní obchodní aktivity pro daný nástroj do jediného záznamu (ISIN, XOFF, datum provedení).	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{MIC} obchodního systému nebo systematického internalizátora nebo „XOFF“
4	Označení pozastaveného nástroje	Ukazatel toho, zda bylo obchodování s nástrojem v příslušném obchodním systému v den provedení pozastaveno po celý den. V důsledku toho se pole 5 vykazuje s nulovou hodnotou.	RM, MTF, OTF	„TRUE“ – pokud byl nástroj pozastaven na celý obchodní den nebo „FALSE“ – pokud nástroj nebyl pozastaven na celý obchodní den
5	Celkový počet obchodů	Celkový počet obchodů provedených v den provedení. Obchody, které byly zrušeny, musí být z hlášených údajů vyloučeny. Obchody, které využívají odklad uveřejnění, se započítávají do souhrnných údajů poskytnutých předkládajícími subjekty na základě data provedení. Ve všech případech musí být pole vyplněno hodnotou větší nebo rovnou nule. U nástrojů, které jsou pozastaveny na celý den, musí mít pole nulovou hodnotu.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
6	Celkový objem	Celkový objem provedený v den provedení. Objem se měří podle tabulky 4 přílohy II tohoto nařízení. Peněžní částky se uvádějí v eurech. Obchody, které byly zrušeny, musí být z hlášených údajů vyloučeny. Obchody, které využívají odklad uveřejnění, se započítávají do souhrnných údajů poskytnutých předkládajícími subjekty na základě data provedení.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

Č.	Pole	Podrobnosti, které se mají vykazovat	Druh místa provedení nebo uveřejnění	Formát a normy pro oznamování
7	Rozmezí pásma „objem obchodu“	<p>Toto pole se vyplní hodnotami uvedenými v tabulkách 3 a 4 této přílohy.</p> <p>Rozmezí pásem objemu obchodů jsou definována:</p> <p>v tabulce 4 této přílohy pro povolenky na emise a jejich deriváty;</p> <p>v tabulce 3 této přílohy pro ostatní nástroje.</p> <p>U nástrojů, které jsou pozastaveny na celý den, se údaje týkající se tohoto pole a polí 8 a 9 neuvádějí.</p>	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{ALPHANUM - -140}
8	Celkový počet obchodů provedených pro dané pásmo	<p>Celkový počet obchodů provedených v den provedení, jejichž objem je v rozmezí pásma.</p> <p>Obchody, které byly zrušeny, musí být z hlášených údajů vyloučeny.</p> <p>Obchody, které využívají odklad uveřejnění, se započítávají do souhrnných údajů poskytnutých předkládajícími subjekty na základě data provedení.</p>	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
9	Celkový obchodovaný objem pro dané pásmo	<p>Celkový obchodovaný objem představovaný všemi obchody provedenými v den vykazování, jejichž objem je v rozmezí pásma.</p> <p>Objem se měří podle tabulky 4 přílohy II tohoto nařízení.</p> <p>Peněžní částky se uvádějí v eurech.</p> <p>Obchody, které byly zrušeny, musí být z hlášených údajů vyloučeny.</p> <p>Obchody, které využívají odklad uveřejnění, se započítávají do souhrnných údajů poskytnutých předkládajícími subjekty na základě data provedení.</p>	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

Tabulka 3

Pásma objemu obchodů pro dluhopisy, strukturované finanční produkty, sekuritizované deriváty, úrokové deriváty, akciové deriváty, měnové deriváty, úvěrové deriváty, komoditní deriváty, deriváty C10 a finanční rozdílové smlouvy

Rozsah	Pásma objemu obchodu	Definice
Obchody o objemu mezi 0 a 1,000,000 (vyjma)]0 – 100,000[Obchody o objemu menším než 100,000 EUR
	[100,000 – 100,000]	Obchody o objemu rovném 100,000 EUR
]100,000 – 200,000[Obchody o objemu větším než 100,000 EUR a menším než 200,000 EUR
	[200,000 – 300,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 200,000 EUR a menším než 300,000 EUR
	[300,000 – 400,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 300,000 EUR a menším než 400,000 EUR
	[Y – Y + 100,000[Obchody o objemu větším nebo rovném Y EUR a menším než Y + 100,000 EUR (krok 100,000 EUR)
	[900,000 – 1,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 900,000 EUR a menším než 1,000,000 EUR
Obchody o objemu mezi 1,000,000 (včetně) a 10,000,000 (vyjma)	[1,000,000 – 1,500,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 1,000,000 EUR a menším než 1,500,000 EUR
	[1,500,000 – 2,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 1,500,000 EUR a menším než 2,000,000 EUR
	[Z – Z + 500,000[Obchody o objemu větším nebo rovném Z EUR a menším než Z + 500,000 EUR (krok 500,000 EUR)
	[9,500,000 – 10,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 9,500,000 EUR a menším než 10,000,000 EUR

Rozsah	Pásmo objemu obchodu	Definice
Obchody o objemu mezi 10,000,000 (včetně) a 100,000,000 (vyjma)	[10,000,000 – 15,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 10,000,000 EUR a menším než 15,000,000 EUR
	[15,000,000 – 20,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 15,000,000 EUR a menším než 20,000,000 EUR
	[W – W + 5,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném W EUR a menším než W + 5,000,000 EUR (krok 5,000,000 EUR)
	[95,000,000 – 100,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 95,000,000 EUR a menším než 100,000,000 EUR
Obchody o objemu větším nebo rovném 100,000,000	[100,000,000 – 125,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 100,000,000 EUR a menším než 125,000,000 EUR
	[125,000,000 – 150,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 125,000,000 EUR a menším než 150,000,000 EUR
	[X – X + 25,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném X EUR a menším než X + 25,000,000 EUR (krok 25,000,000 EUR)
...

Tabulka 4

Rozmezí pásem objemu obchodů pro povolenky na emise a deriváty na emisní povolenky

Rozsah	Pásmo objemu obchodu	Definice
Obchody o objemu mezi 0 a 1,000,000 (vyjma)]0 – 100,000[Obchody o objemu menším než 100,000 tun ekvivalentu oxidu uhličitého (tCO ₂ e)
	[100,000 – 100,000]	Obchody o objemu rovném 100,000 tCO ₂ e
]100,000 – 200,000[Obchody o objemu větším než 100,000 tCO ₂ e a menším než 200,000 tCO ₂ e
	[200,000 – 300,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 200,000 tCO ₂ e a menším než 300,000 tCO ₂ e
	[300,000 – 400,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 300,000 tCO ₂ e a menším než 400,000 tCO ₂ e
	[Y – Y + 100,000[Obchody o objemu větším nebo rovném Y tCO ₂ e a menším než Y tCO ₂ e + 100,000 (krok 100,000 tCO ₂ e)
	[900,000 – 1,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 900,000 tCO ₂ e a menším než 1,000,000 tCO ₂ e

Rozsah	Pásmo objemu obchodu	Definice
Obchody o objemu mezi 1,000,000 (včetně) a 10,000,000 (vyjma)	[1,000,000 – 1,500,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 1,000,000 tCO ₂ e a menším než 1,500,000 tCO ₂ e
	[1,500,000 – 2,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 1,500,000 tCO ₂ e a menším než 2,000,000 tCO ₂ e
	[Z – Z + 500,000[Obchody o objemu větším nebo rovném Z tCO ₂ e a menším než Z tCO ₂ e + 500,000 (krok 500,000 tCO ₂ e)
	[9,500,000 – 10,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 9,500,000 tCO ₂ e a menším než 10,000,000 tCO ₂ e
Obchody o objemu mezi 10,000,000 (včetně) a 100,000,000 (vyjma)	[10,000,000 – 15,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 10,000,000 tCO ₂ e a menším než 15,000,000 tCO ₂ e
	[15,000,000 – 20,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 15,000,000 tCO ₂ e a menším než 20,000,000 tCO ₂ e
	[W – W + 5,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném W tCO ₂ e a menším než W tCO ₂ e + 5,000,000 (krok 5,000,000 tCO ₂ e)
	[95,000,000 – 100,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 95,000,000 tCO ₂ e a menším než 100,000,000 tCO ₂ e
Obchody o objemu větším nebo rovném 100,000,000	[100,000,000 – 125,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 100,000,000 tCO ₂ e a menším než 125,000,000 tCO ₂ e
	[125,000,000 – 150,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném 125,000,000 tCO ₂ e a menším než 150,000,000 tCO ₂ e
	[X – X + 25,000,000[Obchody o objemu větším nebo rovném X tCO ₂ e a menším než X tCO ₂ e + 25,000,000 (krok 25,000,000 tCO ₂ e)
...“

ISSN 1977-0626 (elektronické vydání)
ISSN 1725-5074 (papírové vydání)



Úřad pro publikace Evropské unie
L-2985 Lucemburk
LUCSEMBURSKO

CS