

Teataja



Eestikeelne väljaanne

Õigusaktid

66. aastakäik

16. mai 2023

Sisukord

II Muud kui seadusandlikud aktid

MÄÄRUSED

- ★ Komisjoni delegeeritud määrus (EL) 2023/944, 17. jaanuar 2023, millega muudetakse ja parandatakse delegeeritud määruses (EL) 2017/587 sätestatud regulatiivseid tehnilisi standardeid seoses teatavate läbipaistvusnõuetega, mida kohaldatakse kapitaliinstrumentidega tehtavate tehingute suhtes ⁽¹⁾ 1
- ★ Komisjoni delegeeritud määrus (EL) 2023/945, 17. jaanuar 2023, millega muudetakse delegeeritud määruses (EL) 2017/583 sätestatud regulatiivseid tehnilisi standardeid seoses mittekapitaliinstrumentidega tehtavate tehingute suhtes kohaldatavate läbipaistvusnõuetega ⁽¹⁾ 17

⁽¹⁾ EMPs kohaldatav tekst

Aktid, mille pealkiri on trükitud harilikus trükikirjas, käsitlevad põllumajandusküsimuste igapäevast korraldust ning nende kehtivusaeg on üldjuhul piiratud.

Kõigi ülejäänud aktide pealkirjad on trükitud poolpaksus kirjas ja nende ette on märgitud tärn.

II

(Muud kui seadusandlikud aktid)

MÄÄRUSED

KOMISJONI DELEGEERITUD MÄÄRUS (EL) 2023/944,

17. jaanuar 2023,

millega muudetakse ja parandatakse delegeeritud määruses (EL) 2017/587 sätestatud regulatiivseid tehnilisi standardeid seoses teatavate läbipaistvusnõuetega, mida kohaldatakse kapitaliinstrumentidega tehtavate tehingute suhtes

(EMPs kohaldatav tekst)

EUROOPA KOMISJON,

võttes arvesse Euroopa Liidu toimimise lepingut,

võttes arvesse Euroopa Parlamendi ja nõukogu 15. mai 2014. aasta määrust (EL) nr 600/2014 finantsinstrumentide turgude kohta ning millega muudetakse määrust (EL) nr 648/2012, ⁽¹⁾ eriti selle artikli 4 lõike 6 kolmandat lõiku, artikli 7 lõike 2 kolmandat lõiku, artikli 14 lõike 7 kolmandat lõiku, artikli 20 lõike 3 kolmandat lõiku, artikli 22 lõike 3 teist lõiku ja artikli 23 lõike 3 kolmandat lõiku,

ning arvestades järgmist:

- (1) Võttes arvesse komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/587 ⁽²⁾ kohaldamisel saadud kogemusi ja selliste sätete ebajärjekindlat kohaldamist, mis tuginevad sellele, kas tehing on „hinda mittekujundav“ või mitte, ning võttes arvesse kauplemistavade muutusi, mis tulenevad tehnoloogia arengust ja turuosaliste käitumise muutusest, mis võimaldavad teabe avaldamist kiiremini, tuleb muuta kõnealuse delegeeritud määruse teatavaid sätteid.
- (2) Järelevalve all olevad üksused on tõlgendanud erinevalt „hinda mittekujundavate tehingute“ kontseptsiooni, mis on asjakohane määratud vastaspoolega tehingute vabastuse, aktsiaga kohustusliku kauplemise ja kahepoolsete tehingute puhul kauplemisjärgse läbipaistvuse nõuetest erandi kohaldamiseks, mistõttu on kauplemisjärgse läbipaistvuse teabe avaldamine ebajärjekindel. Läbipaistvuse ja andmete kvaliteedi parandamiseks ning lõppkokkuvõttes andmete koondamise hõlbustamiseks on vaja lihtsustada ja täpsustada aktsiatehingute puhul kohaldatavat aruandluskorda. Erineva tõlgendamise vältimiseks tuleks ühtlustada sätteid, mis tuginevad nii delegeeritud määruses (EL) 2017/587 kui ka komisjoni delegeeritud määruses (EL) 2017/590 ⁽³⁾ (mis käsitleb pädevatele asutustele tehingutest teatamist) sätestatud hinda mittekujundavate tehingute kontseptsioonile. Delegeeritud määruses (EL) 2017/590 on sätestatud kõik tehingud, mille puhul võib teha erandi aruandlusnõuetest, ja seepärast tuleks delegeeritud määrusest (EL) 2017/587 eraldi tehingud välja jätta.

⁽¹⁾ ELT L 173, 12.6.2014, lk 84.

⁽²⁾ Komisjoni 14. juuli 2016. aasta delegeeritud määrus (EL) 2017/587, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 finantsinstrumentide turgude kohta seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad kauplemiskohtade ja investeerimisühingute läbipaistvusnõudeid seoses aktsiaga, hoidmistunnistustega, börsil kaubeldavate fondidega, sertifikaatidega ja muude sarnaste finantsinstrumentidega, samuti tehingute tegemisega seotud kohustusi kauplemiskohas või kliendi korralduste süsteemsete täitjate kaubeldavate teatavate aktsiate puhul (ELT L 87, 31.3.2017, lk 387).

⁽³⁾ Komisjoni 28. juuli 2016. aasta delegeeritud määrus (EL) 2017/590, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad pädevatele asutustele tehingutest teatamist (ELT L 87, 31.3.2017, lk 449).

- (3) Kui viia hinda mittekujundavate tehingute kontseptsioon kooskõlla delegeeritud määruse (EL) 2017/590 vastava kontseptsiooniga, muudab see mõisted „üleandmistehing“ ja „vastuvõtmistehing“ üleliigseks, kuna neid kasutati üksnes seda kontseptsiooni järgivates sätetes. Lisaks ei kasutata kõnealuses delegeeritud määruses mõistet „väärt-paberite kaudu finantseerimise tehing“. Seepärast tuleks kõnealused mõisted välja jätta.
- (4) Kuiigi aktsiate ja aktsialaadsete instrumentide kauplemiseelne läbipaistvus tänu delegeeritud määruse (EL) 2017/587 kohaldamisele suurenes, on börsil kaubeldavate fondide puhul kauplemiseelse läbipaistvuse tase endiselt madal. See on tingitud sellest, et praegu kohaldatakse börsil kaubeldavate fondidega tehtavatest tehingutest märkimisväärse osa (nii tehingute arvu kui ka kauplemismahu seisukohast) puhul vabastust, eelkõige määruse (EL) nr 600/2014 artikli 4 lõike 1 punktis c sätestatud suuremahulisuse vabastust. Seetõttu ei ole täielikult saavutatud kõnealuse määruse eesmärk suurendada börsil kaubeldavate fondide turu läbipaistvust. Selleks et suurendada börsil kaubeldavate fondide puhul kauplemiseelset läbipaistvust reaajas, tuleb tõsta börsil kaubeldavate fondide puhul kohaldatavat kauplemiseelse läbipaistvuse suuremahulisuse vabastuse künnist. Künnise tõstmine tagab, et börsil kaubeldavate fondidega tehtavate tehingute puhul kohaldatakse reaajas kauplemiseelse läbipaistvuse nõudeid, tagades samal ajal piisava kaitse suuremahuliste korralduste hinnamõju eest.
- (5) Samuti on börsil kaubeldavate fondide puhul kauplemisjärgse läbipaistvuse tase endiselt madal, kuna börsil kaubeldavate fondidega tehtavate tehingute puhul on edasilükatud avaldamiste osakaal märkimisväärselt suurem kui aktsiate ja muude kapitaliinstrumentide puhul. Tagamaks, et börsil kaubeldavate fondidega tehtavate tehingute puhul kohaldatakse reaajas kauplemisjärgse läbipaistvuse nõuet, tuleb suurendada börsil kaubeldavate fondidega tehtavate tehingute kvalifitseeruvat miinimummahtu, mille puhul on õigus 60minutilisele edasilükkamisele. Künnise tõstmine loob õige tasakaalu ühelt poolt reaajas läbipaistvuse suurendamise ja teiselt poolt suurte korralduste esitamise võimaliku negatiivse mõju eest piisava kaitse tagamise vahel.
- (6) Turuosalisel on tõlgendanud hübriidkauplemissüsteemide kauplemiseelse läbipaistvuse nõudeid erinevalt, mistõttu on selliste süsteemide korraldajad avaldanud kauplemiseelse läbipaistvuse teavet ebajärjekindlalt. Hübriidsüsteemid on süsteemid, milles on ühendatud kaks või rohkem kauplemissüsteemi. Selleks et kõnealused ettevõtjad avalikustaksid asjakohase kauplemiseelse läbipaistvuse teabe järjepidevalt kogu liidus, tuleks hübriidkauplemissüsteemide suhtes kehtestada kauplemiseelse läbipaistvuse nõuded, mis tagavad kooskõla hübriidsüsteemi kuuluvate eraldiseisvate süsteemide suhtes kohaldatavate nõuetega.
- (7) Tehnoloogia ja turu areng, näiteks lühema latentsusajaga süsteemide suurem kasutamine, võimaldab turuosalistel esitada teavet tehingute kohta varem. Seda arvesse võttes on võimalus avaldada edasilükatud kauplemisjärgne teave hiljemalt järgmise kauplemispäeva keskpäeval tehingute puhul, mis on tehtud vähem kui kaks tundi enne kauplemispäeva lõppu, tarbetult pikk. Selleks et tagada kauplemisjärgse teabe õigeaegne avaldamine, tuleb lühendada seda ajavahemikku hiljemalt kella 9ni järgmisel kauplemispäeval kohaliku aja järgi.
- (8) Kauplemiskohad, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustajad ja investeerimisühingud ei tõlgenda järjepidevalt nõudeid, mis käsitlevad kauplemisjärgse läbipaistvuse teabe avalikustamist üldsusele ning teabe esitamist Euroopa Väärtpaberiturujärelevalvele (ESMA) ja pädevatele asutustele läbipaistvusarvutuste tegemiseks. Seetõttu on selline teave puudulik, ebatäpne või ebajärjepidev. See kahjustab sellise teabe kasutatavust ning esitatud andmetel põhinevate läbipaistvusarvutuste kvaliteeti ja täpsust. Selleks et edendada kauplemisjärgse läbipaistvuse nõuete järjepidevat kohaldamist kogu liidus, tuleb täiendavalt täpsustada andmepäringute sisu ning eelkõige üksikasju, mille kauplemiskohad, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustajad ja kauplemiskoondteabe pakkujad peavad avalikustama, kui nad esitavad ESMA-le ja pädevatele asutustele võrdlus- ja kvantitatiivsed andmed.
- (9) Seepärast tuleks delegeeritud määrust (EL) 2017/587 vastavalt muuta.

- (10) Selleks et kauplemisskohad, tunnustatud kauplemisteabeandluse avalikustajad ja investeerimisühingud saaksid nõutud muudatused oma süsteemides rakendada, tuleks teatavaid käesoleva määrusega kehtestatud muudatusi kohaldada alates 1. jaanuarist 2024. Selleks et tagada õiguskindlus ja järjepidevus tehingute puhul, mis on tehtud enne 1. jaanuari 2024, kuid mis on avaldatud või mida on muudetud pärast seda kuupäeva, tuleks nende tehingute puhul jätkuvalt kohaldada delegeeritud määruse (EL) 2017/587 artikleid 2, 6 ja 13 ning I lisa, nagu neid kohaldatakse 31. detsembril 2023.
- (11) Käesolev määrus põhineb ESMA poolt komisjonile esitatud regulatiivsete tehniliste standardite eelnõul.
- (12) ESMA on korraldanud käesoleva määruse aluseks oleva regulatiivsete tehniliste standardite eelnõu kohta avalikud konsultatsioonid, analüüsinud võimalikku kaasnevat kulu ja kasu ning küsinud nõu Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) nr 1095/2010 (*) artikli 37 kohaselt loodud väärtpapierituru sidusrühmade kogult,

ON VASTU VÕTNUD KÄESOLEVA MÄÄRUSE:

Artikkel 1

Delegeeritud määruse (EL) 2017/587 muutmine

Delegeeritud määrust (EL) 2017/587 muudetakse järgmiselt.

- 1) Artikli 1 punktid 2 ja 3 jäetakse välja.
- 2) Artiklit 2 muudetakse järgmiselt:
 - a) punktid d ja i jäetakse välja;
 - b) lisatakse punkt j:

„j) tehing ei ole tehing määruse (EL) nr 600/2014 artikli 26 kohaldamisel vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 (*) artikli 2 lõikele 5.
- 3) Artiklit 6 muudetakse järgmiselt:
 - a) punktid d ja i jäetakse välja;
 - b) lisatakse punkt k:

„k) tehing ei ole tehing määruse (EL) nr 600/2014 artikli 26 kohaldamisel vastavalt delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 2 lõikele 5.“
- 4) Artikli 7 lõige 2 asendatakse järgmisega:

„2. Börsil kaubeldava fondiga seotud korraldus loetakse suuremahuliseks, kui korraldus on võrdne 3 000 000 euroga või sellest suurem.“
- 5) Artikli 13 punktid b, c ja d jäetakse välja.
- 6) Artikli 15 lõike 3 punkt b asendatakse järgmisega:

„b) punktiga a hõlmamata tehingute puhul hiljemalt likviidsuse seisukohast kõige asjakohasema turu järgmise kauplemispäeva alguses.“

(*) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 24. novembri 2010. aasta määrus (EL) nr 1095/2010, millega asutatakse Euroopa Järelevalveasutus (Euroopa Väärtpapieriturujärelevalve), muudetakse otsus nr 716/2009/EÜ ning tunnistatakse kehtetuks komisjoni otsus 2009/77/EÜ (ELT L 331, 15.12.2010, lk 84).

7) Artiklit 17 muudetakse järgmiselt:

a) lõige 2 asendatakse järgmisega:

„2. Pädevad asutused, turukorraldajad ja investeerimisühingud, sealhulgas kauplemisskohta korraldavad investeerimisühingud, kasutavad käesoleva artikli lõike 1 kohaselt avaldatud teavet määruse (EL) nr 600/2014 artikli 4 lõike 1 punktide a ja c ning artikli 14 lõigete 2 ja 4 kohaldamisel ajavahemikul alates selle aasta aprilli esimesest esmaspäevast, mil teave avaldati, kuni järgmise aasta aprilli esimesele esmaspäevale eelneva päevani.“;

b) lisatakse lõiked 6 ja 7:

„6. Kui ESMA või pädevad asutused nõuavad teavet vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artiklile 22, esitavad kauplemisskohad, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustajad ja kauplemisskoondteabe pakkujad sellise teabe vastavalt käesoleva määruse IV lisale.

7. Kui artikli 7 lõigete 1 ja 2, artikli 8 lõike 2 punkti a, artikli 11 lõike 1 ja artikli 15 lõike 1 kohaldamisel kindlaks määratud tehingumaht on väljendatud rahalises väärtuses ja finantsinstrument ei ole nomineeritud eurodes, konverteeritakse tehingumaht valuutasse, milles finantsinstrument on nomineeritud, kohaldades Euroopa Keskpanga euro vahetuskurssi eelmise aasta 31. detsembri seisuga.“

8) I lisa muudetakse vastavalt käesoleva määruse I lisale.

9) II lisa muudetakse vastavalt käesoleva määruse II lisale.

10) Käesoleva määruse III lisas esitatud tekst lisatakse IV lisana.

Artikkel 2

Delegeeritud määruse (EL) 2017/587 parandused

Delegeeritud määrust (EL) 2017/587 parandatakse järgmiselt.

1) Artikli 9 punkt b asendatakse järgmisega:

„b) kord vastab tehnilisele korrale, mis on samaväärne delegeeritud määruse (EL) 2017/571 artiklis 14 tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustajate puhul kindlaks määratud korraga, mis hõlbustab andmete konsolideerimist muudest allikatest pärinevate sarnaste andmetega;“.

2) Artikkel 18 asendatakse järgmisega:

„Artikkel 18

Viide pädevatele asutustele

(määruse (EL) nr 600/2014 artikli 22 lõige 1)

Konkreetsed finantsinstrumendi puhul pädev asutus, kes vastutab arvutuste tegemise ning artiklites 4, 7, 11 ja 17 osutatud teabe avaldamise tagamise eest, on määruse (EL) nr 600/2014 artikli 26 kohase ja delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 16 täpsustatud, likviidsuse seisukohast kõige asjakohasema turu pädev asutus.“

Artikkel 3

Üleminekusäte

Delegeeritud määruse (EL) 2017/587 artikleid 2, 6 ja 13 ning I lisa, nagu neid kohaldatakse 31. detsembril 2023, kohaldatakse jätkuvalt enne 1. jaanuari 2024 tehtud tehingute suhtes.

*Artikkel 4***Jõustumine ja kohaldamine**

Käesolev määrus jõustub kahekümnendal päeval pärast selle avaldamist *Euroopa Liidu Teatajas*.

Artikli 1 punkte 2, 3, 5 ja 8 kohaldatakse alates 1. jaanuarist 2024.

Käesolev määrus on tervikuna siduv ja vahetult kohaldatav kõikides liikmesriikides.

Brüssel, 17. jaanuar 2023

Komisjoni nimel
president
Ursula VON DER LEYEN

I LISA

Delegeeritud määruse (EL) 2017/587 I lisa muudetakse järgmiselt.

1) Tabel 1 asendatakse järgmisega:

„Tabel 1

Kauplemissüsteemi liikide kirjeldus ja seonduv teave, mis avalikustatakse vastavalt artiklile 3

| Rida | Kauplemissüsteemi liik | Kauplemissüsteemi kirjeldus | Avalikustatav teave |
|------|--|---|---|
| 1 | Tellimusraamatupõhine kestevoksjoni kauplemissüsteem | Süsteem, mis inimeste sekkumiseta toimiva tellimusraamatu ja kauplemisalgoritmi abil sobitab pidevalt müügikorraldusi ostukorraldustega parima võimaliku hinna alusel. | Korralduste ja aktsiate, hoidmistunnistuste, börsil kaubeldavate fondide, sertifikaatide ja muude sarnaste finantsinstrumentide koguarv, mida instrumendid igal hinnatasemel esindavad, vähemalt viie parima ostu- ja müügipakkumise hinnataseme lõikes. |
| 2 | Noteeringupõhine kauplemissüsteem | Süsteem, kus tehingud sõlmitakse fikseeritud noteeringute alusel, mis tehakse osalistele pidevalt kättesaadavaks, ning mis nõuab turutegijatel sellises mahus noteeringute hoidmist, mis tasakaalustab liikmete ja osaliste vajaduse kaubelda ärilises mahus ning turutegija riski. | Iga turutegija parim ostu- ja müügipakkumine kauplemissüsteemis kaubeldavate aktsiate, hoidmistunnistuste, börsil kaubeldavate fondide, sertifikaatide ja muude sarnaste finantsinstrumentide puhul koos nende hindadega seonduvate kogustega. Avalikustatavad hinnapakkumised on need, mis kujutavad endast siduvaid kohustusi finantsinstrumente osta ja müüa ning näitavad ära finantsinstrumentide hinna ja koguse, mille juures registreeritud turutegijad on valmis ostma või müüma. Erandlike turutingimuste korral võivad piiratud aja jooksul olla lubatud ka orienteeruvad või ühepoolsed hinnad. |
| 3 | Perioodioksjonipõhine kauplemissüsteem | Inimeste sekkumiseta toimiv süsteem, mis sobitab korraldusi perioodioksjoni ja kauplemisalgoritmi põhjal. | Hind, mille puhul oksjonipõhine kauplemissüsteem vastaks aktsiate, hoidmistunnistuste, börsil kaubeldavate fondide, sertifikaatide ja muude sarnaste finantsinstrumentide puhul kõige paremini oma kauplemisalgoritmile, ja kogus, mille ulatuses selles süsteemis osalejad võiksid kõnealuse hinna korral potentsiaalselt tehinguid teha. |

| Rida | Kauplemissüsteemi liik | Kauplemissüsteemi kirjeldus | Avalikustatav teave |
|------|-------------------------------------|--|--|
| 4 | Hinnapäringupõhine kauplemissüsteem | Süsteem, milles hinnapakkumine või -pakkumised tehakse vastusena ühe või mitme liikme või osaleja esitatud hinnapäringule. Hinnapakkumise korral saab tehingu teha üksnes hinnapäringu esitanud liige või osaleja. Hinnapäringu esitanud liige või osaleja võib teha tehingu, aktsepteerides talle päringu alusel tehtud hinnapakkumise või -pakkumised. | Iga liikme või osaleja hinnapakkumised ja seonduvad kogused, mis aktsepteerimise korral tootsid süsteemi eeskirjade alusel kaasa tehingu. Kõik hinnapäringule vastuks esitatud hinnapakkumised võib avalikustada samal ajal, aga hiljemalt siis, kui need muutuvad täidetavaks. |
| 5 | Hübriidkauplemissüsteem | Süsteem, mis kuulub selle tabeli ridades 1–4 osutatud kahte või enamasse kauplemissüsteemi liiki. | Kombineeritud süsteemide puhul, kus kombineeritakse eri kauplemissüsteeme samaaegselt, vastavad nõuded kauplemiseelse läbipaistvuse nõuetele, mida kohaldatakse kombineeritud süsteemi moodustava iga kauplemissüsteemi liigi suhtes. Kombineeritud süsteemide puhul, kus kombineeritakse kahte või enam kauplemissüsteemi järjestikuliselt, vastavad nõuded kauplemiseelse läbipaistvuse nõuetele, mida kohaldatakse konkreetsel ajahetkel kasutatava vastava kauplemissüsteemi suhtes. |
| 6 | Mis tahes muu kauplemissüsteem | Mis tahes muud liiki kauplemissüsteem, mis ei ole hõlmatud ridadega 1–5. | Asjakohane teave korralduste või hinnapakkumiste taseme ja kauplemishuvi taseme kohta kauplemissüsteemis kaubeldavate aktsiate, hoidmistunnistuste, börsil kaubeldavate fondide, sertifikaatide ja muude sarnaste finantsinstrumentide puhul; eelkõige viis paremat ostu- ja müügipakkumise hinnataset ja/või kõnealuse finantsinstrumendiga kaupleva iga turutegija kahepoolsed ostu- ja müügipakkumised, kui hinna kindlaksmääramise mehhanism seda võimaldab.“ |

2) Tabelid 3 ja 4 asendatakse järgmistega:

„Tabel 3

Kauplemisjärgse läbipaistvuse eesmärgil esitatavate andmete loetelu

| Nr | Andmevälja tähis | Kirjeldus ja avaldatavad andmed | Täitmis- või avaldamiskoha liik | Kasutatav vorming, nagu on määratletud tabelis 2 |
|----|--------------------------------|--|--|--|
| 1 | Kauplemise kuupäev ja kellaaeg | Tehingu tegemise kuupäev ja kellaaeg. Kauplemiskohas tehtud tehingute puhul detailsuse tase kooskõlas delegeeritud määruse (EL) 2017/574 artiklis 2 sätestatud nõuetega. Mujal kui kauplemiskohas tehtud tehingute puhul kuupäev ja kellaaeg, kui pooled lepivad kokku järgmiste väljade sisu: kogus, hind, valuutad (nagu on kindlaks määratud delegeeritud määruse (EL) 2017/590 I lisa tabeli 2 andmeväljadel 31, 34 ja 44), instrumendi tunnuscode, instrumendi klass ja alusinstrumendi | Reguleeritud turg (RM) Mitmepoolne kauplemissüsteem (MTF) Tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja (APA) Kauplemiskoondteabe pakkuja (CTP) | {DATE_TIME_FORMAT} |

| Nr | Andmevälja tähis | Kirjeldus ja avaldatavad andmed | Täitmis- või avaldamiskoha liik | Kasutatav vorming, nagu on määratletud tabelis 2 |
|----|------------------------|--|---------------------------------|---|
| | | <p>kood, kui see on asjakohane. Tehingute puhul, mida ei tehtud kauple-miskohas, esitatakse kellaaeg vähe-malt lähima sekundi täpsusega.</p> <p>Kui tehing tuleneb korraldusest, mille täitev ühing on edastanud kliendi nimel kolmandale isikule, kui delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud edas-tamise tingimused ei olnud täidetud, on see tehingu kuupäev ja kellaaeg, mitte korralduse edastamise aeg.</p> | | |
| 2 | Instrumendi tunnuscode | Finantsinstrumendi tuvastamiseks kasutatav kood. | RM, MTF, APA, CTP | {ISIN} |
| 3 | Hind | <p>Hind, millega tehing tehti, välja arvatud (kui see on asjakohane) vahendustasu ja kogunenud intres-sid.</p> <p>Kui hind on väljendatud rahalises väärtuses, esitatakse see peamise valuuta ühikus.</p> <p>Kui andmed hinna kohta puuduvad, ent ollakse nende ootel („PNDG“), või kui hinda ei kohaldata („NOAP“), siis seda lahtrit ei täideta.</p> | RM, MTF, APA, CTP | <p>{DECIMAL-18/13}, kui hinda väljendatakse rahalises väärtuses aktsiate ja aktsialaadsete finantsinstrumentide puhul.</p> <p>{DECIMAL-11/10}, kui hinda väljendatakse protsentides või tootlusena sertifikaatide ja muude aktsialaadsete finantsinstrumentide puhul.</p> |
| 4 | Puuduv hind | <p>Kui andmed hinna kohta puuduvad, ent ollakse nende ootel, on väärtus „PNDG“.</p> <p>Kui hinda ei kohaldata, märgitakse „NOAP“.</p> | RM, MTF, APA, CTP | <p>„PNDG“ juhul, kui hind ei ole kättesaadav</p> <p>„NOAP“ juhul, kui hinda ei kohaldata</p> |
| 5 | Hinna valuuta | Peamise valuuta ühik, milles hinda väljendatakse (kohaldatakse juhul, kui hinda väljendatakse rahalises väärtuses) | RM, MTF, APA, CTP | {CURRENCYCODE_3} |
| 6 | Hinnanoteering | Märke, kas hinda väljendatakse raha-lises väärtuses, protsentides või toot-lusena. | RM, MTF, APA, CTP | <p>„MONE“ – rahalises väärtuses</p> <p>aktsiate ja aktsialaadsete finantsinstrumentide puhul</p> <p>„PERC“ – protsentides</p> |

| Nr | Andmevälja tähis | Kirjeldus ja avaldatavad andmed | Täitmis- või avaldamiskoha liik | Kasutatav vorming, nagu on määratletud tabelis 2 |
|----|------------------|--|---------------------------------|---|
| | | | | <p>sertifikaatide ja muude aktsialaadsete finantsinstrumentide puhul</p> <p>„YIEL“ – tootlusena</p> <p>sertifikaatide ja muude aktsialaadsete finantsinstrumentide puhul</p> <p>„BAPO“ – baaspunktides</p> <p>sertifikaatide ja muude aktsialaadsete finantsinstrumentide puhul</p> |
| 7 | Kogus | <p>Finantsinstrumendi ühikute arv.</p> <p>Finantsinstrumendi nimiväärtus või rahaline väärtus.</p> | RM, MTF, APA, CTP | <p>{DECIMAL-18/17}, kui kogus on väljendatud ühikute arvuna.</p> <p>{DECIMAL-18/5}, kui kogus on väljendatud rahalises või nimivääruses.</p> |
| 8 | Täitmiskoht | <p>Selle täitmiskoha tunnuskoode, kus tehing tehti.</p> <p>ELi kauplemisskohas tehtud tehingute puhul kasutage ISO 10383 segmendi MICi. Kui segmendi MIC puudub, kasutage korraldaja MICi.</p> <p>Finantsinstrumentide puhul, mis lubati kauplemisele või millega kaubeldakse kauplemisskohas, ja kui selle finantsinstrumendiga tehti tehing kliendi korralduste süsteemse täitja kaudu, kasutage koodi „SINT“.</p> <p>Finantsinstrumentide puhul, mis lubati kauplemisele või millega kaubeldakse kauplemisskohas, ja kui selle finantsinstrumendiga ei tehtud tehingut ELi kauplemisskohas ega kliendi korralduste süsteemse täitja kaudu, kasutage MIC-koodi „XOFF“.</p> <p>Kui tehing tehakse ELi-välisel organiseeritud kauplemissplatvormil, tuleb lisaks MIC-koodile „XOFF“ täita ka andmevälja „Kolmanda riigi kauplemisskoht, kus tehing tehti“.</p> | RM, MTF, APA, CTP | <p>{MIC} – ELi kauplemisskohad või</p> <p>„SINT“ – kliendi korralduste süsteemne täitja</p> <p>„XOFF“ – muul juhul</p> |

| Nr | Andmevälja tähis | Kirjeldus ja avaldatavad andmed | Täitmis- või avaldamiskoha liik | Kasutatav vorming, nagu on määratletud tabelis 2 |
|----|--|---|---------------------------------|---|
| 9 | Kolmanda riigi kauplemiskoht, kus tehing tehti | <p>Kolmanda riigi sellise kauplemiskoha tunnuskoode, kus tehing tehti. Kasutage ISO 10383 segmendi MICi. Kui segmendi MIC puudub, kasutage korraldaja MICi.</p> <p>Kui tehingut ei tehta kolmanda riigi kauplemiskohas, siis andmevälja ei täideta.</p> | APA, CTP | {MIC} |
| 10 | Avalikustamise kuupäev ja kellaeg | <p>Kuupäev ja kellaeg, millal kauplemiskoht või tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja tehingu avalikustas.</p> <p>Kauplemiskohas tehtud tehingute puhul detailsuse tase kooskõlas delegeritud määruse (EL) 2017/574 artiklis 2 sätestatud nõuetega.</p> <p>Tehingute puhul, mida ei tehtud kauplemiskohas, esitatakse kellaeg vähemalt lähima sekundi täpsusega.</p> | RM, MTF, APA, CTP | {DATE_TIME_FORMAT} |
| 11 | Avalikustamise koht | Tehingut avalikustava kauplemiskoha või tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja tuvastamiseks kasutatav kood. | CTP | <p>kauplemiskoht: {MIC}</p> <p>APA: ISO 10383 segmendi MIC (4 märki), kui see on olemas. Muul juhul ESMA veebisaidil esitatud aruandlusteenuste pakujate loetelus avaldatud neljakohaline kood.</p> |
| 12 | Tehingu tunnuskoode | <p>Tähtnumbriline kood, mille on määranud kauplemiskohad (kooskõlas komisjoni delegeritud määruse (EL) 2017/580 (1) artikliga 12) ja tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustajad ning mida kasutatakse edaspidi mis tahes viitamisel konkreetsele tehingule.</p> <p>Tehingu tunnuskoode on kordumatu, ühtne ja püsiv ISO 10383 segmendi MICi ning kauplemispäeva kohta. Kui kauplemiskoht ei kasuta segmendi MICi, on tehingu tunnuskoode kordumatu, ühtne ja püsiv korraldaja MICi ja kauplemispäeva kohta.</p> | RM, MTF, APA, CTP | {ALPHANUM-52} |

| Nr | Andmevälja tähis | Kirjeldus ja avaldatavad andmed | Täitmis- või avaldamiskoha liik | Kasutatav vorming, nagu on määratletud tabelis 2 |
|----|------------------|---|---------------------------------|--|
| | | <p>Kui tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja ei kasuta MICi, on see kordumatu, ühtne ja püsiv neljakohaline kood, mida kasutatakse tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja tuvastamiseks kauplemispäeva kohta.</p> <p>Tehingu tunnuskoode komponendid ei tohi avalikustada sellise tehingu vastaspoolte andmeid, millele kood viitab.</p> | | |

(¹) Komisjoni 24. juuni 2016. aasta delegeeritud määrus (EL) 2017/580, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad finantsinstrumentidega seotud korralduste asjaomaste andmete säilitamist (ELT L 87, 31.3.2017, lk 193).

Tabel 4

Kauplemisjärge läbipaistvuse eesmärgil kasutatavate märgiste loetelu

| Märgis | Nimetus | Täitmis- või avaldamiskoha liik | Kirjeldus |
|--------|---|---------------------------------|--|
| „BENC“ | Märgis „Võrdlustehingud“ | RM, MTF APA CTP | Tehingud, mis on tehtud viitega hinnale, mis on arvatud mitme ajapunkti kohta vastavalt teatavale võrdlusalusele, nagu mahuga kaalutud keskmine hind või ajaga kaalutud keskmine hind. |
| „NPFT“ | Märgis „Hinda mittekujundavad tehingud“ | RM, MTF CTP | Hinda mittekujundavad tehingud, nagu on sätestatud delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 2 lõikes 5. |
| „PORT“ | Märgis „Portfellitehingud“ | RM, MTF APA CTP | Viie või enama finantsinstrumendiga tehtavad tehingud, kusjuures neid teeb üks ja sama klient ühel ja samal ajal ning ühtse kogumina konkreetse võrdlushinnaga. |
| „CONT“ | Märgis „Tingimuslikud tehingud“ | RM, MTF APA CTP | Tehingud, mis sõltuvad tuletislepingu või muu finantsinstrumendi ostust, müügist, loomisest või tagasivõtmisest, mille puhul tuleb kõik tehingu osad teha ühe kogumina. |
| „ACTX“ | Märgis „Vahendaja risttehing“ | APA CTP | Tehingud, kus investeerimisühing on koondanud kokku klientide korraldused, kusjuures ost ja müük tehakse ühe tehinguna ning see hõlmab ühte ja sama kogust ja hinda. |
| „SDIV“ | Märgis „Spetsiaalne dividenditehing“ | RM, MTF APA CTP | Tehingud, mis tehakse: dividendideta perioodil, kui dividendid või muus vormis väljamaksed kogunevad ostjale, mitte müüjale, või dividendidega perioodil, kui dividendid või muus vormis väljamaksed kogunevad müüjale, mitte ostjale. |

| Märgis | Nimetus | Täitmis- või avaldamiskoha liik | Kirjeldus |
|--------|--|---------------------------------|--|
| „LRGS“ | Märgis „Kauplemissjargne suuremahuline tehing“ | RM, MTF APA CTP | Turu tavalise tehingumahuga võrreldes suuremahuliseks kvalifitseeruvad tehingud, mille puhul on artikli 15 kohaselt lubatud avaldamisega viivitada. |
| „RFPT“ | Märgis „Võrdlushinnaga tehing“ | RM, MTF CTP | Tehingud, mis tehakse vastavalt määruse (EL) nr 600/2014 artikli 4 lõike 1 punktile a toimivates süsteemides. |
| „NLIQ“ | Märgis „Määratud vastaspoolega tehingud likviidsete finantsinstrumentidega“ | RM, MTF CTP | Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 4 lõike 1 punkti b alapunkti i kohaselt tehtud tehingud. |
| „OILQ“ | Märgis „Määratud vastaspoolega tehingud mittelikviidsete finantsinstrumentidega“ | RM, MTF CTP | Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 4 lõike 1 punkti b alapunkti ii kohaselt tehtud tehingud. |
| „PRIC“ | Märgis „Määratud vastaspoolega tehingud, mille suhtes kohaldatakse muid tingimusi kui kehtiv turuhind“ | RM, MTF CTP | Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 4 lõike 1 punkti b alapunkti iii kohaselt ja artiklis 6 sätestatu kohaselt tehtud tehingud. |
| „ALGO“ | Märgis „Algoritmipõhised tehingud“ | RM, MTF CTP | Direktiivi 2014/65/EL artikli 4 lõike 1 punktis 39 määratletud algoritmkauplemisega tegeleva investeerimisühingu tehtud tehingud. |
| „SIZE“ | Märgis „Turu tavamahtu ületav tehing“ | APA CTP | Kliendi korralduste süsteemse täitja tehtud tehingud, kus sissetuleva korralduse suurus ületas vastavalt artiklile 11 kindlaks määratud turu tavamahtu. |
| „ILQD“ | Mittelikviidse instrumendi tehingu märgis | APA CTP | Kliendi korralduste süsteemse täitja kaudu tehtud tehingud mittelikviidsete finantsinstrumentidega, nagu on kindlaks määratud kooskõlas komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/567 ⁽¹⁾ artiklitega 1–5. |
| „RPRI“ | Märgis „Tehingud, mille hinda on parendatud“ | APA CTP | Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 15 lõike 2 kohaselt kliendi korralduste süsteemse täitja kaudu hindade parendamisega tehtud tehingud. |
| „CANC“ | Tühistamismärgis | RM, MTF APA CTP | Kui varem avaldatud tehing tühistatakse. |
| „AMND“ | Muutmismärgis | RM, MTF APA CTP | Kui varem avaldatud tehingut muudetakse. |
| „DUPL“ | Märgis „Dubleerivad kauplemisteabearuanded“ | APA | Kui tehingust teatatakse enam kui ühele kauplemisteabearuandluse avalikustajale vastavalt delegeeritud määruse (EL) 2017/571 artikli 16 lõikele 1. |

⁽¹⁾ Komisjoni 18. mai 2016. aasta delegeeritud määrus (EL) 2017/567, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 seoses mõistete, läbipaistvuse, portfelliidest tihendamise ning toodetesse sekkumise ja positsioonide juhtimise järelevalvemeetmetega (ELT L 87, 31.3.2017, lk 90).“

II LISA

Delegeeritud määruse (EL) 2017/587 II lisa tabel 5 asendatakse järgmisega:

„Tabel 5

Avaldamise edasilükkamisel kohaldatavad künnised ja kestused börsil kaubeldavate fondide puhul

| Lubatud edasilükkamise jaoks kvalifitseerumiseks vajalik minimaalne tehingumaht eurodes | Tehingujärgse avaldamise ajastamine |
|---|-------------------------------------|
| 15 000 000 | 60 minutit |
| 50 000 000 | Kauplemispäeva lõpp“ |

III LISA

„IV LISA

Andmed, mis tuleb esitada, et määrata kindlaks kõige asjakohasem turg likviidsuse, keskmise päevakäibe ja tehingute keskmise väärtuse seisukohast

Tabel 1

Tähiste tabel

| Tähis | Andmete liik | Määratlus |
|---------------|--|---|
| {ALPHANUM-n} | Kuni n tähtnumbrilist märki | Vabateksti väli |
| {ISIN} | 12 tähtnumbrilist märki | ISIN kood, nagu on määratletud standardis ISO 6166 |
| {MIC} | 4 tähtnumbrilist märki | Turu tunnuscode, nagu on määratletud standardis ISO 10383 |
| {DATEFORMAT} | ISO 8601 kuupäevavorming | Kuupäevad tuleb esitada järgmisel kujul: AAAA-KK-PP. |
| {DECIMAL-n/m} | Kuni n-kohaline kümnendarv, milles võib olla m kohta pärast koma | Andmeväljale kantakse kas positiivne või negatiivne arv. kümnendkohtade eraldusmärk on punkt (.); negatiivsete arvude ees on miinus (-); väärtused ümardatakse, neid ei kärbita. |
| {INTEGER-n} | Kuni n-kohaline täisarv | Andmeväljale kantakse kas positiivne või negatiivne täisarv. |

Tabel 2

Üksikasjad, mis tuleb esitada, et määrata kindlaks kõige asjakohasem turg likviidsuse, keskmise päevakäibe ja tehingute keskmise väärtuse seisukohast (praeguste aruandlusjuhiste kohaselt)

| Andmevälja number | Andmevälja tähis | Kirjeldus ja avaldatavad andmed | Täitmis- või avaldamiskoha liik | Kasutatav vorming, nagu on määratletud tabelis 1 |
|-------------------|------------------------|---|--|--|
| 1 | Instrumendi tunnuscode | Finantsinstrumendi tuvastamiseks kasutatav kood | Reguleeritud turg (RM) Mitmepoolne kauplemissüsteem (MTF) Tunnustatud kauplemisebearuandluse avalikustaja (APA) Kauplemiskoondteabe pakkuja (CTP) | {ISIN} |
| 2 | Täitmiskuupäev | Tehingute tegemise kuupäev. | RM, MTF, APA, CTP | {DATEFORMAT} |

| Andmevälja number | Andmevälja tähis | Kirjeldus ja avaldatavad andmed | Täitmis- või avaldamiskoha liik | Kasutatav vorming, nagu on määratletud tabelis 1 |
|-------------------|--|--|---------------------------------|--|
| 3 | Täitmiskoht | <p>ELi kauplemisskoha või kliendi korralduste süsteemse täitja segmendi MIC, kui see on asjakohane, muul juhul korraldaja MIC.</p> <p>MIC XOFF, kui tehingu teevad investeerimisühingud, kes ei ole kliendi korralduste süsteemsed täitjad, ja seda tehingut ei tehta kauplemisskohas.</p> | RM, MTF, APA, CTP | Kauplemisskoha või kliendi korralduste süsteemse täitja {MIC} või {MIC}-XOFF. |
| 4 | Peatatud instrumendi märgis | <p>Märgis selle kohta, kas instrument peatati täitmiskuupäeval vastavas kauplemisskohas kogu kauplemisspäevaks.</p> <p>Kuna instrument peatati kogu kauplemisspäevaks, märgitakse andmeväljadel 5–10 väärtuseks null.</p> | RM, MTF, CTP | <p>ÕIGE – kui instrument peatati kogu kauplemisspäevaks</p> <p>VALE – kui instrumenti ei peatatud kogu kauplemisspäevaks</p> |
| 5 | Tehingute koguarv | Täitmiskuupäeval tehtud tehingute koguarv (**). | RM, MTF, APA, CTP | {INTEGER-18} |
| 6 | Kogukäive | Täitmiskuupäeval tehtud tehingute kogukäive eurodes (*) (**) | RM, MTF, APA, CTP | {DECIMAL-18/5} |
| 7 | Tehtud tehingud, välja arvatud kõik tehingud, mis on tehtud määruse (EL) nr 600/2014 artikli 4 lõike 1 punktides a, b ja c sätestatud kauplemiseelsete vabastuste alusel. | Täitmiskuupäeval tehtud tehingute koguarv, välja arvatud kõik tehingud, mis on tehtud samal päeval määruse (EL) nr 600/2014 artikli 4 lõike 1 punktides a, b ja c sätestatud kauplemiseelsete vabastuste alusel (**). | RM, MTF, CTP | {INTEGER-18} |
| 8 | Tehtud tehingute kogukäive, välja arvatud kõik tehingud, mis on tehtud määruse (EL) nr 600/2014 artikli 4 lõike 1 punktides a, b ja c sätestatud kauplemiseelsete vabastuste alusel. | Tehtud tehingute kogukäive täitmiskuupäeval, välja arvatud kõik tehingud, mis on tehtud samal päeval määruse (EL) nr 600/2014 artikli 4 lõike 1 punktides a, b ja c sätestatud kauplemiseelsete vabastuste alusel (*) (**). | RM, MTF, CTP | {DECIMAL-18/5} |

| Andmevälja number | Andmevälja tähis | Kirjeldus ja avaldatavad andmed | Täitmis- või avaldamiskoha liik | Kasutatav vorming, nagu on määratletud tabelis 1 |
|-------------------|--|--|---------------------------------|--|
| 9 | Tehingute koguarv, välja arvatud tehingud, mis on tehtud kauplemisjärgse suuremahulise tehingu vabastuse edasilükkamise alusel. | <p>Täitmiskuupäeval tehtud tehingute koguarv, välja arvatud suuremahulise tehingu vabastuse alusel tehtud tehingud (kauplemisjärgne (**)).</p> <p>Aktsiate ja hoidmistunnistuste puhul tuleb nende tehingute identifitseerimiseks kasutada ainult II lisa tabelis 4 esitatud vastava keskmise päevakäibe vahemiku kõrgeimat künnist.</p> <p>Sertifikaatide ja muude sarnaste finantsinstrumentide puhul tuleb nende tehingute identifitseerimiseks kasutada ainult II lisa tabelis 6 esitatud kõrgeimat künnist.</p> <p>Börsil kaubeldavate fondide puhul tuleb nende tehingute identifitseerimiseks kasutada ainult II lisa tabelis 5 esitatud kõrgeimat künnist.</p> | RM, MTF, APA, CTP | {INTEGER-18} |
| 10 | Tehtud tehingute kogukäive, välja arvatud tehingud, mis on tehtud kauplemisjärgse suuremahulise tehingu vabastuse edasilükkamise alusel. | <p>Täitmiskuupäeval tehtud tehingute kogukäive, välja arvatud suuremahulise tehingu vabastuse alusel tehtud tehingud (kauplemisjärgne) (*) (**).</p> <p>Aktsiate ja hoidmistunnistuste puhul tuleb nende tehingute identifitseerimiseks kasutada ainult II lisa tabelis 4 esitatud vastava keskmise päevakäibe vahemiku kõrgeimat künnist.</p> <p>Sertifikaatide ja muude sarnaste finantsinstrumentide puhul tuleb nende tehingute identifitseerimiseks kasutada ainult II lisa tabelis 6 esitatud kõrgeimat künnist.</p> <p>Börsil kaubeldavate fondide puhul tuleb nende tehingute identifitseerimiseks kasutada ainult II lisa tabelis 5 esitatud kõrgeimat künnist.</p> | RM, MTF, APA, CTP | {DECIMAL-18/5} |

(*) Käibe arvutamiseks korrutatakse ostjate ja müüjate vahel vahetatud instrumentide arv selle konkreetse tehingu jaoks vahetatud instrumendi ühikuhinnaga ning käivet väljendatakse eurodes.

(**) Tühistatud tehingud tuleb esitatavatest andmetest välja jätta.

Igal juhul tuleb andmeväljale märkida mis tahes väärtus, mis on suurem kui null või võrdne nulliga (kuni 18 numbrilist märki, sealhulgas kuni 5 kümnendkohta).“

KOMISJONI DELEGEERITUD MÄÄRUS (EL) 2023/945,**17. jaanuar 2023,****millega muudetakse delegeeritud määruses (EL) 2017/583 sätestatud regulatiivseid tehnilisi standardeid seoses mittekapitaliinstrumentidega tehtavate tehingute suhtes kohaldatavate läbipaistvusnõuetega****(EMPs kohaldatav tekst)**

EUROOPA KOMISJON,

võttes arvesse Euroopa Liidu toimimise lepingut,

võttes arvesse Euroopa Parlamendi ja nõukogu 15. mai 2014. aasta määrust (EL) nr 600/2014 finantsinstrumentide turgude kohta ning millega muudetakse määrust (EL) nr 648/2012, ⁽¹⁾ eriti selle artikli 9 lõike 5 kolmandat lõiku, artikli 11 lõike 4 kolmandat lõiku, artikli 14 lõike 7 kolmandat lõiku, artikli 21 lõike 5 kolmandat lõiku ja artikli 22 lõike 3 teist lõiku,

ning arvestades järgmist:

- (1) Võttes arvesse komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/583 ⁽²⁾ kohaldamisel saadud kogemusi ja kuna on kindlaks tehtud selliste sätete ebajärjekindel kohaldamine, mis põhinevad sellel, kas tehing on hinda mittekujundav või mitte, samuti võttes arvesse tehnoloogia arengust ja turuosaliste käitumise muutumisest tulenevaid muutusi kauplemistavades, mis võimaldab teavet avaldada lühema viiteajaga, on vaja kõnealuse delegeeritud määruse teatavaid sätteid muuta.
- (2) Järelevalve alla kuuluvad üksused tõlgendavad erinevalt hinda mittekujundavate tehingute mõistet, mis on asjakohane kauplemisjärgse läbipaistvuse nõuetest erandi tegemiseks kahepoolsete tehingute puhul, ning see on põhjustanud ebajärjekindlust kauplemisjärgse läbipaistvuse teabe avaldamisel kooskõlas Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) nr 600/2014 ⁽³⁾ artikliga 21. Läbipaistvuse ja andmekvaliteedi parandamiseks ning lõppkokkuvõttes andmete koondamise hõlbustamiseks on vaja mittekapitalitehingute suhtes kohaldatavat aruandlus-korda lihtsustada ja täpsustada. Lahknevate tõlgenduste vältimiseks tuleks hinda mittekujundavate tehingute mõistel põhinevad sätted nii delegeeritud määruses (EL) 2017/587 ⁽⁴⁾ kui ka pädevatele asutustele tehingutest teatamist käsitlevas komisjoni delegeeritud määruses (EL) 2017/590 ⁽⁵⁾ ühtlustada. Kuna delegeeritud määruses (EL) 2017/590 esitatud hinda mittekujundavate tehingute loetelu sisaldab kõiki tehinguid, mis tuleb aruandlusnõuetest välja arvata, tuleks delegeeritud määrusest (EL) 2017/587 eraldi tehingud seega välja jätta.
- (3) Turuosalisel tõlgendaval hübriidkauplemissüsteemide puhul kauplemiseelse läbipaistvuse nõudeid erinevalt, mille tulemusena on selliste süsteemide korraldajate avaldatud kauplemiseelse läbipaistvuse teave ebajärjekindel. Hübriidsüsteemid on süsteemid, milles on ühendatud kaks või rohkem kauplemissüsteemi. Selleks et kõnealused ettevõtjad avalikustaksid asjakohase kauplemiseelse läbipaistvuse teabe järjepidevalt kogu liidus, tuleks hübriidkauplemissüsteemide suhtes kehtestada kauplemiseelse läbipaistvuse nõuded, mis tagavad kooskõla hübriidsüsteemi kuuluvate eraldiseisvate süsteemide suhtes kohaldatavate nõuetega.

⁽¹⁾ ELT L 173, 12.6.2014, lk 84.

⁽²⁾ Komisjoni 14. juuli 2016. aasta delegeeritud määrus (EL) 2017/583, millega täiendatakse finantsinstrumentide turge käsitlevat Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad kauplemiskohtade ja investeerimisühingute suhtes kohaldatavaid läbipaistvuse nõudeid võlakirjade, struktureeritud finantstoodete, lubatud heitkoguste väärtpaberite ning tuletisinstrumentide puhul (ELT L 87, 31.3.2017, lk 229).

⁽³⁾ Euroopa Parlamendi ja nõukogu 15. mai 2014. aasta määrus (EL) nr 600/2014 finantsinstrumentide turgude kohta ning millega muudetakse määrust (EL) nr 648/2012 (ELT L 173, 12.6.2014, lk 84).

⁽⁴⁾ Komisjoni 14. juuli 2016. aasta delegeeritud määrus (EL) 2017/587, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 finantsinstrumentide turgude kohta seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad kauplemiskohtade ja investeerimisühingute läbipaistvusnõudeid seoses aktsiatega, hoidmistunnistustega, börsil kaubeldavate fondidega, sertifikaatidega ja muude sarnaste finantsinstrumentidega, samuti tehingute tegemisega seotud kohustusi kauplemiskohas või kliendi korralduste süsteemsete täitjate kaubeldavate teatavate aktsiate puhul (ELT L 87, 31.3.2017, lk 387).

⁽⁵⁾ Komisjoni 28. juuli 2016. aasta delegeeritud määrus (EL) 2017/590, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad pädevatele asutustele tehingutest teatamist (ELT L 87, 31.3.2017, lk 449).

- (4) Finantsinstrumentidega tehtud tehinguid käsitlevates avalikes aruannetes on teatavaid põhielemente, nagu hind, kogus ja tinglik väärtus, väljendatud ebajärjekindlalt. Nende elementide väljendamine peaks olema kooskõlas konkreetsete õigusaktidega seotud turustandarditega. Võlakirjade hinda tuleks väljendada protsentides, välja arvatud juhul, kui turustandardi kohaselt väljendatakse teatavat liiki võlakirjade hinda teisiti. Krediidiriski vahetustehingute hinda tuleks väljendada krediidiriski kaitse müüja saadud baaspunktides.
- (5) Tehingud, kus mitu erinevat võlakirja või muud finantsinstrumenti müüakse portfellitehinguna samaaegselt ühele kliendile, sealhulgas vastaspooltele, kõiki instrumente hõlmava ühe hinna eest, ei ole avalikes aruannetes sellisena äratuntavad. Kui selliseid portfellitehinguid täpselt ei tuvastata, esitatakse avalikes aruannetes mitu üksiktehingut hinnaga, mis ei kajasta turuhinda. Delegeeritud määruse (EL) 2017/587 II lisa tabelisse 3 on seetõttu vaja lisada selliste tehingute tuvastamiseks portfellitehingute märgis.
- (6) Kauplemiskohad, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustajad ja investeerimisühingud on nõudeid, mis käsitlevad kauplemisjärgse läbipaistvuse teabe avalikustamist üldsusele ning samuti Euroopa Väärtpaberiturujärelevalvele (ESMA) ja pädevatele asutustele läbipaistvusarvutuste jaoks esitatavat teavet, ebajärjekindlalt tõlgendanud. Seetõttu on selline teave mittetäielik, ebatäpne või ebajärjekindel. See vähendab sellise teabe kasutatavust ning esitatud andmetel põhinevate läbipaistvusarvutuste kvaliteeti ja täpsust. Selleks et edendada kauplemisjärgse läbipaistvuse nõuete järjekindlat kohaldamist kogu liidus, on vaja täpsustada, kuidas kauplemiskohad, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustajad ja kauplemiskohad peaksid sellised üksikasjad nagu hind ja tinglik väärtus eri finantsinstrumentide puhul avalikustama ning kuidas esitada võrdlusandmed ja kvantitatiivsed andmed ESMA-le ja pädevatele asutustele.
- (7) Kaubatuletisinstrumentide likviidsus varieerub oluliselt sõltuvalt instrumentide omadustest. Delegeeritud määruses (EL) 2017/583 ei ole kauba- ja veose tuletisinstrumentide teatavate omaduste esitamise vormingut praegu piisavalt täpsustatud. Selleks et saavutada nende omaduste järjekindel esitamine ja parandada andmekvaliteeti, peaksid need vormid tuginema olemasolevatele turustandarditele ja neid tuleks täpsustada.
- (8) Delegeeritud määrust (EL) 2017/583 tuleks seetõttu vastavalt muuta.
- (9) Teatavaid käesoleva määrusega kehtestatud muudatusi tuleks kohaldada alates 1. jaanuarist 2024, et kauplemiskohad, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustajad ja investeerimisühingud saaksid teha oma süsteemides nõutud muudatused. Selleks et tagada õiguskindlus ja järjepidevus tehingute puhul, mis on tehtud enne 1. jaanuari 2024, kuid mis avaldatakse või mida muudetakse pärast seda kuupäeva, tuleks enne 1. jaanuari 2024 tehtud tehingute suhtes kohaldada jätkuvalt delegeeritud määruse (EL) 2017/583 artiklit 12 ning I, II ja IV lisa 31. detsembri 2023. aasta seisuga.
- (10) Käesolev määrus põhineb ESMA poolt komisjonile esitatud regulatiivsete tehniliste standardite eelnõul.
- (11) ESMA on korraldanud käesoleva määruse aluseks oleva regulatiivsete tehniliste standardite eelnõu kohta avalikud konsultatsioonid, analüüsinud võimalikke seonduvaid kulusid ja kasu ning küsinud nõu Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) nr 1095/2010 (6) artikli 37 kohaselt loodud väärtpaberituru sidusrühmade kogult,

ON VASTU VÕTNUD KÄESOLEVA MÄÄRUSE:

Artikkel 1

Delegeeritud määruse (EL) 2017/583 muudatused

Delegeeritud määrust (EL) 2017/583 muudetakse järgmiselt.

- (1) Artiklisse 4 lisatakse lõige 4:

„4. Lõike 2 punkti a kohaldamisel mõõdetakse korralduste haldamise süsteemis hoitavate korralduste mahtu II lisa tabeli 2 lahtris 10 osutatud kaubeldavate lepingute tingliku väärtuse alusel.“

(6) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 24. novembri 2010. aasta määrus (EL) nr 1095/2010, millega asutatakse Euroopa Järelevalveasutus (Euroopa Väärtpaberiturujärelevalve), muudetakse otsus nr 716/2009/EÜ ning tunnistatakse kehtetuks komisjoni otsus 2009/77/EÜ (ELT L 331, 15.12.2010, lk 84).

(2) Artikkel 12 asendatakse järgmisega:

„Artikkel 12

Kauplemisjärgse läbipaistvuse nõuete kohaldamine teatavate väljaspool kauplemiskohta tehtavate tehingute suhtes

(Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 21 lõige 1)

Määruse (EL) nr 600/2014 artikli 21 lõikes 1 sätestatud kohustusi ei kohaldata komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/590 (*) artikli 2 lõikes 5 loetletud tehingute suhtes.

(*) Komisjoni 28. juuli 2016. aasta delegeeritud määrus (EL) 2017/590, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad pädevatele asutustele tehingutest teatamist (C/2016/4733; ELT L 87, 31.3.2017, lk 449).“

(3) Artiklit 13 muudetakse järgmiselt:

(a) lõikele 5 lisatakse järgmine lõik:

„Esimeses lõigus osutatud andmeid kogutakse kooskõlas V lisaga.“;

(b) lõige 17 asendatakse järgmisega:

„17. Pädevad asutused tagavad iga finantsinstrumendi ja finantsinstrumentide klassi puhul lõikes 5 osutatud arvutuste tulemuste avalikustamise määruse (EL) nr 600/2014 kohaldamise kuupäevale järgneva aasta 30. aprilliks ning seejärel iga aasta 30. aprilliks. Arvutuste tulemusi kohaldatakse alates avaldamisele järgneva iga aasta juuni esimesest esmaspäevast kuni järgmise aasta juuni esimesele esmaspäevale eelneva päevani;“

18. Lõike 1 punkti b alapunktis i osutatud arvutuste puhul ning erandina lõigetest 7, 15 ja 17 tagavad pädevad asutused võlakirjade (v.a börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad) puhul lõike 5 punktis a osutatud arvutuste kvartaalse avalikustamise määruse (EL) nr 600/2014 kohaldamise kuupäevale järgneva veebruari, mai, augusti ja novembri esimesel esmaspäeval ning seejärel iga aasta veebruari, mai, augusti ja novembri esimesel esmaspäeval. Arvutused hõlmavad liidus eelneva kalendrikvartali jooksul tehtud tehinguid ning neid kohaldatakse alates iga aasta veebruari, mai, augusti ja novembri kolmandast esmaspäevast kuni järgmise kvartali arvutuste tegemiseni.“.

(4) I lisa asendatakse käesoleva määruse I lisa tekstiga.

(5) II lisa muudetakse vastavalt käesoleva määruse II lisale.

(6) III lisa muudetakse vastavalt käesoleva määruse III lisale.

(7) IV lisa muudetakse vastavalt käesoleva määruse IV lisale.

(8) Käesoleva määruse V lisas esitatud tekst lisatakse V lisana.

Artikkel 2

Üleminekusäte

Enne 1. jaanuari 2024 tehtud tehingute suhtes kohaldatakse jätkuvalt delegeeritud määruse (EL) 2017/583 artiklit 12 ning I, II ja IV lisa 31. detsembri 2023. aasta seisuga.

*Artikkel 3***Jõustumine ja kohaldamine**

Käesolev määrus jõustub kahekümnendal päeval pärast selle avaldamist *Euroopa Liidu Teatajas*.

Artikli 1 punkte 2, 4, 5 ja 7 kohaldatakse alates 1. jaanuarist 2024.

Käesolev määrus on tervikuna siduv ja vahetult kohaldatav kõikides liikmesriikides.

Brüssel, 17. jaanuar 2023

Komisjoni nimel

president

Ursula VON DER LEYEN

I LISA

„I LISA

Süsteemi liigi kirjeldus ja artikli 2 kohaselt avalikustatav seonduv teave

| Süsteemi liik | Süsteemi kirjeldus | Avalikustatav teave |
|---|---|--|
| Tellimusraamatupõhine kestevoxsjoni kauplemis-süsteem | Süsteem, mis inimeste sekkumiseta toimiva tellimusraamatu ja kauplemis-algoritmi abil sobitab pidevalt müügi- ja ostukorraldustega parima võimaliku hinna alusel. | Iga finantsinstrumendi puhul korralduste koguarv ja neile vastav maht igal hinnatasemel, vähemalt viie parima ostu- ja müügi-pakkumiste hinna tase-mel. |
| Noteeringupõhine kaup-le- missüsteem | Süsteem, kus tehingud sõlmitakse fikseeritud noteeringute alusel, mis tehakse osalistele pidevalt kättesaa-davaks, ning mis nõuab turutegijatelt sellises mahus noteeringute hoidmist, mis tasakaalustab liikmete ja osaliste vajaduse kaubelda ärilises mahus ning turutegija riski. | Iga finantsinstrumendi puhul iga selle inst-rumendi turutegija parim ostu- ja müügi-pakku-mine hinna järgi koos nende hindadega seondu-vate mahtudega. Avalikustatavad hinnapakumised on need, mis kujutavad endast siduvaid kohustusi finantsinst-strumente osta ja müüa ning näitavad ära finants-instrumentide hinna ja mahu, mille juures regist-reeritud turutegijad on valmis ostma või müüma. Erandlike turutingimuste korral võivad piiratud aja jooksul olla lubatud ka orienteerivad või ühepoolsed hinnad. |
| Perioodioksjonipõhine kauplemis-süsteem | Inimeste sekkumiseta toimiv süsteem, mis sobitab korraldusi perioodioksjoni ja kauplemis-algoritmi põhjal. | Iga finantsinstrumendi puhul hind, millega oksjonipõhine kauplemis-süsteem vastab kõige paremini kauplemis-algortimile, ja maht, mille ulatuses selles süsteemis osalejad võiksid selle hinna korral potentsiaalselt tehinguid teha. |
| Hinnapäringupõhine kauplemis-süsteem | Kauplemis-süsteem, kus hinnapakku-mine või -pakkumised esitatakse vastu-sena hinnapäringule, mille on esitanud üks või mitu teist liiget või osalejat. Hinnapakumist saab kasutada üksnes päringu teinud liige või turuosaline. Hinnapäringu esitanud liige või osaleja võib sõlmida tehingu, aktsepteerides talle päringu alusel esitatud hinnapak-kumise või -pakkumised. | Iga liikme või osaleja hinnapakumised ja seon-duvad mahud, mis aktsepteerimise korral tooksid süsteemi eeskirjade alusel kaasa tehingu. Kõik hinnapäringule vastuseks esitatud hinnapakku-mised võib avalikustada samal ajal, aga hiljemalt siis, kui need muutuvad täidetavaks. |
| Häälkauplemis-süsteem | Kauplemis-süsteem, kus liikmetevahe-lised tehingud toimuvad häälega peetavate läbirääkimiste kaudu. | Iga liikme või osaleja ostu- ja müügi-pakkumised ning seonduvad mahud, mis aktsepteerimise korral tooksid süsteemi eeskirjade alusel kaasa tehingu. |

| Süsteemi liik | Süsteemi kirjeldus | Avalikustatav teave |
|--------------------------------|---|--|
| Hübriidkauplemissüsteem | Süsteem, mida saaks liigitada kahte või enamasse käesoleva tabeli esimesel kuni viiendal real osutatud kauplemissüsteemi liiki. | <p>Selliste hübriidkauplemissüsteemide puhul, milles on eri kauplemissüsteemid ühendatud samal ajal, vastavad nõuded iga hübriidsüsteemi kuuluva kauplemissüsteemi liigi suhtes kohaldatavatele kauplemiseelse läbipaistvuse nõuetele.</p> <p>Selliste hübriidkauplemissüsteemide puhul, milles on kaks või enam kauplemissüsteemi ühendatud üksteise järel, vastavad nõuded asjaomase konkreetset hetkel kasutatava kauplemissüsteemi suhtes kohaldatavatele kauplemiseelse läbipaistvuse nõuetele.</p> |
| Mis tahes muu kauplemissüsteem | Esimeses kuues reas kajastamata mis tahes muud liiki kauplemissüsteem. | Piisav teave korralduste või hinnapakumiste taseme ning kauplemissüsteemi kohta; eelkõige viie parima ostu- ja müügipakkumise hinnatase ja/või instrumendiga kaupleva iga turutegija ostu- ja müügipakkumised, kui hinna leidmise mehhanism seda võimaldab.“ |

II LISA

II lisa muudetakse järgmiselt.

1) Tabel 2 asendatakse järgmisega:

„Tabel 2

Kauplemisjärgse läbipaistvuse eesmärgil esitatavate andmete loetelu

| Nr | Lahtri tähis | Finantsinstrumendid | Kirjeldus ja avaldatavad andmed | Täitmis- või avalikustamiskoha liik | Täidetavate andmete vorming, nagu on määratletud tabelis 1 |
|----|-------------------------------|------------------------------------|--|--|--|
| 1 | Kauplemise kuupäev ja kellaeg | Kõikide finantsinstrumentide puhul | <p>Tehingu tegemise kuupäev ja kellaeg.</p> <p>Kauplemiskohas tehtud tehingute puhul on detailsuse tase kooskõlas komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/574⁽¹⁾ artiklis 2 sätestatud nõuetega.</p> <p>Tehingute puhul, mida ei tehtud kauplemiskohas, on kuupäev ja kellaeg see kuupäev ja kellaeg, millal pooled lepivad kokku järgmiste lahtrite sisus: kogus, hind, valuutad (nagu on täpsustatud delegeeritud määruse (EL) 2017/590 I lisa tabeli 2 lahtrites 31, 34 ja 44), instrumendi tunnuskood, instrumendi klass ja alusinstrumendi kood, kui see on asjakohane. Tehingute puhul, mida ei tehtud kauplemiskohas, esitatakse kellaeg vähemalt lähima sekundi täpsusega.</p> <p>Kui tehing tuleneb korraldusest, mille täitev ühing on edastanud kliendi nimel kolmandale isikule, kui delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artiklis 4 sätestatud edastamise tingimused ei olnud täidetud, on see tehingu kuupäev ja kellaeg, mitte korralduse edastamise aeg.</p> | Reguleeritud turg Mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem Tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja Kauplemiskoondteabe pakkuja | {DATE_TIME_FORMAT} |
| 2 | Finantsinstrumendi tunnuskood | Kõikide finantsinstrumentide puhul | Finantsinstrumendi tuvastamiseks kasutatav kood | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | {ISIN} |
| 3 | Hind | Kõikide finantsinstrumentide puhul | <p>Hind, millega tehing tehti, välja arvatud (kui see on asjakohane) vahendustasu ja kogunenud intressid.</p> <p>Hind, millega tehing tehti, esitatakse tavalise turustandardi kohaselt. Selles lahtris esitatav väärtus peab olema kooskõlas lahtris „Hinnanoteering“ esitatud väärtusega.</p> <p>Kui andmed hinna kohta puuduvad, ent ollakse nende ootel (PNDG), või kui hinda ei kohaldata (NOAP), siis seda lahtrit ei täideta.</p> | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | {DECIMAL-18/13} juhul, kui hind on väljendatud rahalises väärtuses {DECIMAL-11/10} juhul, kui hind on väljendatud protsentides või tootlusena {DECIMAL-18/17} juhul, kui hind on väljendatud baaspunktides |

| Nr | Lahtri tähis | Finantsinstrumendid | Kirjeldus ja avaldatavad andmed | Täitmis- või avalikustamiskoha liik | Täidetavate andmete vorming, nagu on määratletud tabelis 1 |
|----|----------------|------------------------------------|---|--|---|
| 4 | Puuduv hind | Kõikide finantsinstrumentide puhul | <p>Kui andmed hinna kohta puuduvad, ent ollakse nende ootel, on väärtus PNDG.</p> <p>Kui andmed hinna kohta puuduvad, on väärtus NOAP.</p> | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | <p>PNDG juhul, kui hind ei ole kättesaadav</p> <p>NOAP juhul, kui hinda ei kohaldata</p> |
| 5 | Hinna valuuta | Kõikide finantsinstrumentide puhul | Peamine valuuta, milles hind on väljendatud (asjakohane juhul, kui hind on väljendatud rahalises väärtuses). | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | {CURRENCYCODE_3} |
| 6 | Hinnanoteering | Kõikide finantsinstrumentide puhul | <p>Märge, kas hinda väljendatakse rahalise väärtusena, protsentides, baaspunktides või tootlusena.</p> <p>Hinnanoteering esitatakse tavalise turustandardi kohaselt.</p> <p>Krediidiriski vahetustehingute puhul märgitakse lahtrisse BAPO.</p> <p>Võlakirjade (v.a börsil kaubeldavad võlakirjad ja börsil kaubeldavad kaubad) puhul märgitakse siia lahtrisse tingliku väärtuse protsent (PERC). Kui protsentides väljendatud hind ei ole tavaline turustandard, märgitakse siia lahtrisse tavalise turustandardi kohaselt YIEL, BAPO või MONE.</p> <p>Selles lahtris esitatav väärtus peab olema kooskõlas lahtris „Hind“ esitatud väärtusega.</p> <p>Kui hind on väljendatud rahalises väärtuses, esitatakse see peamise valuuta ühikus.</p> <p>Kui andmed hinna kohta puuduvad, ent ollakse nende ootel (PNDG), või kui hinda ei kohaldata (NOAP), siis seda lahtrit ei täideta.</p> | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | <p>„MONE“ – rahalise väärtusena</p> <p>„PERC“ – protsentides</p> <p>„YIEL“ – tootlusena</p> <p>„BAPO“ – baaspunktides</p> |

| Nr | Laetri tähis | Finantsinstrumentid | Kirjeldus ja avaldatavad andmed | Täitmis- või avalikustamiskoha liik | Täidetavate andmete vorming, nagu on määratletud tabelis 1 |
|----|-------------------------------|--|--|---|---|
| 7 | Kogus | Kõikide finantsinstrumentide puhul, välja arvatud käesoleva määruse artikli 11 lõike 1 punktides a ja b kirjeldatud juhtudel. | Ühikutena kaubeldavate finantsinstrumentide puhul finantsinstrumendi ühikute arv. Muul juhul tühi. | Reguleeritud turg, mitme-poolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | {DECIMAL-18/17} |
| 8 | Kogus mõõtühikutes | Kauba tuletisinstrumentide, C10 tuletisinstrumentide, lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide ning lubatud heitkoguste väärtpaberite ühikutes kindlaksmääratud lepingute puhul, välja arvatud käesoleva määruse artikli 11 lõike 1 punktides a ja b kirjeldatud juhtudel. | Selle kauba või lubatud heitkoguste väärtpaberi, millega kaubeldakse, samaväärne summa mõõtühikutes. | Reguleeritud turg, mitme-poolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | {DECIMAL-18/17} |
| 9 | Koguse märkimine mõõtühikutes | Kauba tuletisinstrumentide, C10 tuletisinstrumentide, lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide ning lubatud heitkoguste väärtpaberite ühikutes kindlaksmääratud lepingute puhul, välja arvatud käesoleva määruse artikli 11 lõike 1 punktides a ja b kirjeldatud juhtudel. | Mõõtühikud, milles kogust väljendatakse. | Reguleeritud turg, mitme-poolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | „TOCD“ – CO ₂ ekvivalenttonnid lubatud heitkoguste väärtpaberitega seotud lepingu puhul „TONE“ – tonnid „MWHO“ – megavatt-tunnid „MBTU“ – üks miljon Briti soojusühikut „THMS“ – thermid „DAYS“ – päevad või {ALPHANUM-4} muul juhul |

| Nr | Lahtri tähis | Finantsinstrumendid | Kirjeldus ja avaldatavad andmed | Täitmis- või avalikustamiskoha liik | Täidetavate andmete vorming, nagu on määratletud tabelis 1 |
|----|-----------------|---|---|--|--|
| 10 | Tinglik väärtus | Kõikide finantsinstrumentide puhul, välja arvatud käesoleva määruse artikli 11 lõike 1 punktides a ja b kirjeldatud juhtudel. | <p>Sellesse lahtrisse märgitakse:</p> <ul style="list-style-type: none"> i) võlakirjade (välja arvatud börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad) puhul nimiväärtus, mis on lunastamisel investorile tagasi makstav summa; ii) börsil kaubeldavate kaupade ja börsil kaubeldavate võlakirjade ning väärtpapieristatud tuletisinstrumentide puhul ostjate ja müüjate vahel vahetatud instrumentide arvu ja selle konkreetse tehingu puhul vahetatud instrumendi hinna korrutis. Teisisõnu lahtrite „Hind“ ja „Kogus“ korrutis; iii) struktureeritud finantstoodete puhul nimiväärtus ühiku kohta korrutatuna instrumentide arvuga tehingu ajal; iv) krediidiriski vahetustehingute puhul tinglik väärtus, mille puhul on kaitse omandatud või võõrandatud; v) optsoonide, vahetusoptsoonide, muude kui alapunktis iv osutatud vahetustehingute, futuuride ja forvardite puhul lepingu tinglik väärtus; vi) lubatud heitkoguste väärtpapierite puhul summa koguse eest lepingus sätestatud hinna korral tehingu ajal. Teisisõnu lahtrite „Hind“ ja „Kogus mõõtühikutes“ korrutis; vii) hinnavahekihlvedude puhul rahaline väärtus alusvaraks oleva finantsinstrumendi punkti muutuse kohta tehingu ajal; viii) hinnavahelepingute puhul ostjate ja müüjate vahel vahetatud instrumentide arvu ja selle konkreetse tehingu puhul vahetatud instrumendi hinna korrutis. Teisisõnu lahtrite „Hind“ ja „Kogus“ korrutis. | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | {DECIMAL-18/5} |

| Nr | Laetri tähis | Finantsinstrumentid | Kirjeldus ja avaldatavad andmed | Täitmis- või avalikustamiskoha liik | Täidetavate andmete vorming, nagu on määratletud tabelis 1 |
|----|-----------------|---|--|---|--|
| 11 | Tinglik valuuta | Kõikide finantsinstrumentide puhul, välja arvatud käesoleva määruse artikli 11 lõike 1 punktides a ja b kirjeldatud juhtudel. | Peamine valuuta, milles tinglik väärtus on nomineeritud. Välisvaluutas tuletislepingu, mitmes valuutas vahetustehingu, sellise vahetusoptiooni, mille alusvara on mitmes valuutas vahetustehing, valuuta hinnavahelepingu või hinnavahekihlveo lepingu puhul esimese poole tinglik valuuta. | Reguleeritud turg, mitme-poolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | {CURRENCYCODE_3} |
| 12 | Liik | Üksnes lubatud heitkoguste väärtpaberite või lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide puhul | Lahter on asjakohane üksnes lubatud heitkoguste väärtpaberite või lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide puhul. | Reguleeritud turg, mitme-poolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | „EUAE“ – LHÜ „CERE“ – THV „ERUE“ – HVÜ „EUAA“ – lennunduse LHÜ „OTHR“ – muu |
| 13 | Täitmiskoht | Kõikide finantsinstrumentide puhul | Selle täitmiskoha tunnuscode, kus tehing täideti. ELi kauplemiskohas tehtud tehingute puhul kasutada ISO 10383 segmendi MICi. Kui segmendi MIC puudub, siis kasutada korraldaja MICi. Kasutada SINTi finantsinstrumentide puhul, mis lubati kauplemiskohas kauplemisele või millega kauplemiskohas kaubeldi, kui selle finantsinstrumenti tehing tehakse kliendi korralduste süsteemse täitja juures. Kasutada MIC-koodi XOFF finantsinstrumentide puhul, mis lubati kauplemiskohas kauplemisele või millega kauplemiskohas kaubeldi, kui selle finantsinstrumenti tehingut ei tehta ELi kauplemiskohas ega kliendi korralduste süsteemse täitja juures. Kui tehing tehakse organiseeritud kauplemisplatvormil, mis asub väljaspool ELi, siis tuleb lisaks XOFFile täita ka lahter „Kolmanda riigi kauplemiskoht, kus toimub täitmine“. | Reguleeritud turg, mitme-poolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | {MIC} – ELi kauplemiskohad või „SINT“ – kliendi korralduste süsteemne täitja „XOFF“ – muul juhul |

| Nr | Lahtri tähis | Finantsinstrumendid | Kirjeldus ja avaldatavad andmed | Täitmis- või avalikustamiskoha liik | Täidetavate andmete vorming, nagu on määratletud tabelis 1 |
|----|---|------------------------------------|--|--|--|
| 14 | Kolmanda riigi kauplemiskoht, kus toimub täitmine | Kõikide finantsinstrumentide puhul | Selle kolmanda riigi täitmiskoha tunnuscode, kus tehing täideti. Kasutada ISO 10383 segmendi MICi. Kui segmendi MIC puudub, siis kasutada korraldaja MICi. Kui tehingut ei tehta kolmanda riigi kauplemiskohas, siis lahtrit ei täideta. | Tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | {MIC} |
| 15 | Avalikustamise kuupäev ja kellaeg | Kõikide finantsinstrumentide puhul | Kuupäev ja kellaeg, millal kauplemiskoht või tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja tehingu avalikustas. Kauplemiskohas tehtud tehingute puhul detailse tase kooskõlas delegeeritud määruse (EL) 2017/574 artiklis 2 sätestatud nõuetega. Tehingute puhul, mida ei tehtud kauplemiskohas, esitatakse kellaeg vähemalt lähima sekundi täpsusega. | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | {DATE_TIME_FORMAT} |
| 16 | Avalikustamise koht | Kõikide finantsinstrumentide puhul | Kood, mida kasutatakse tehingut avalikustava kauplemiskoha või tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja tuvastamiseks. | kauplemiskoondteabe pakkuja | Kauplemiskoht: {MIC} Tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja: {MIC}, kui see on olemas. Vastasel korral neljakohaline kood, mis on avaldatud ESMA veebisaidil andmearuandlus teenuste osutajate loetelus. |
| 17 | Tehingu tunnuscode | Kõikide finantsinstrumentide puhul | Tähtnumbriline kood, mille on määranud kauplemiskohad (kooskõlas komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2017/580 (?) artikliga 12) ja tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustajad ning mida kasutatakse kõikides järgmistes viidetes asjaomasele tehingule. | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | {ALPHANUMERICAL-52} |

| Nr | Lahtri tähis | Finantsinstrumendid | Kirjeldus ja avaldatavad andmed | Täitmis- või avalikustamiskoha liik | Täidetavate andmete vorming, nagu on määratletud tabelis 1 |
|----|------------------|----------------------------|---|--|---|
| | | | <p>Tehingu tunnuscode on kordumatu, ühtne ja püsiv ISO 10383 segmendi MICi ning kauplemispäeva puhul. Kui kauplemiskoht ei kasuta segmendi MICi, on tehingu tunnuscode kordumatu, ühtne ja püsiv korraldaja MICi ning kauplemispäeva puhul.</p> <p>Kui tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja ei kasuta MICi, siis on see kordumatu, ühtne ja püsiv neljakohalise koodi puhul, mida kasutatakse tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja tuvastamiseks kauplemispäeval.</p> <p>Kauplemiskoha tehingu tunnuscode'i komponendid ei tohi avalikustada sellise tehingu vastaspoolte andmeid, mille tunnuscode säilitatakse.</p> | | |
| 18 | Kliiritav tehing | Tuletisinstrumentide puhul | Kood, millega tähistatakse see, kas tehing kliiritakse. | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | „TRUE“ – tehing kliiritakse „FALSE“ – tehingut ei kliirita |

(¹) Komisjoni 7. juuni 2016. aasta delegeeritud määrus (EL) 2017/574, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2014/65/EL seoses äritegevuses kasutatavate kellade täpsust käsitlevate regulatiivsete tehniliste standarditega (ELT L 87, 31.3.2017, lk. 148).

(²) Komisjoni 24. juuni 2016. aasta delegeeritud määrus (EL) 2017/580, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 600/2014 seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, mis käsitlevad finantsinstrumentidega seotud korralduste asjaomaste andmete säilitamist (ELT L 87, 31.3.2017, lk. p. 193).

Delegeeritud määrus (EL) nr 148/2013, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) nr 648/2012 börsiväliste tuletisinstrumentide, kesksete vastaspoolte ja kauplemisteabehoidlate kohta seoses regulatiivsete tehniliste standarditega, millega määratakse kindlaks kauplemisteabehoidlale esitatav miinumusteave.“

2) Tabel 3 asendatakse järgmisega:

„Tabel 3

Kauplemisjärgse läbipaistvuse eesmärgil kasutatavate märgiste loetelu

| Märgis | Nimetus | Täitmis- või avalikustamiskoha liik | Kirjeldus |
|--------|-------------------------------------|--|--|
| „BENC“ | Võrdlustehingu märgis | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Tehingud, mis on tehtud viitega hinnale, mis on arvutatud mitme ajapunkti kohta vastavalt teatavale võrdlusalusele, nagu mahuga kaalutud keskmine hind või ajaga kaalutud keskmine hind. |
| „ACTX“ | Asutuse risttehingu märgis | tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Tehingud, mille puhul investeerimisühing on ühendanud kaks klientide korraldust ostu ja müügiga, mis toimuvad ühe tehinguna ning hõlmavad sama mahtu ja hinda. |
| „NPFT“ | Hinda mittekujundava tehingu märgis | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, kauplemiskoondteabe pakkuja | Hinda mittekujundavad tehingud, nagu on sätestatud delegeeritud määruse (EL) 2017/590 artikli 2 lõikes 5. |

| Märgis | Nimetus | Täitmis- või avalikustamiskoha liik | Kirjeldus |
|--------|---|--|--|
| „LRGS“ | Kauplemisjärgse suuremahulise tehingu märgis | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem Tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja kauplemiskoondteabe pakkuja | Tehingud, mis on tehtud suuremahuliste tehingute kauplemisjärgset viivitust kohaldades. |
| „ILQD“ | Mittelikviidse instrumendi tehingu märgis | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Tehingud, mis on tehtud selliste instrumentide viivitust kohaldades, millel ei ole likviidset turgu. |
| „SIZE“ | Kauplemisjärgse instrumendile omase mahuga tehingu märgis | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Tehingud, mis on tehtud instrumendile omase mahu puhul kauplemisjärgset viivitust kohaldades. |
| „TPAC“ | Kombineeritud tehingu märgis | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Kombineeritud tehingud, mille puhul ei ole tegemist artiklis 1 määratletud füüsilise instrumendi vahetusega. |
| „XFPH“ | Füüsilise instrumendi vahetuse märgis | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Artiklis 1 määratletud füüsilise instrumendi vahetus. |
| „CANC“ | Tühistamismärgis | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Varem avalikustatud tehingu tühistamise korral. |
| „AMND“ | Muutmismärgis | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Varem avalikustatud tehingu muutmise korral. |
| „PORT“ | Portfellitehingu märgis | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Viie või enama erineva finantsinstrumendiga tehtav tehing, mida teeb sama klient samal ajal ja ühtse kogumihinnaga ning mis ei ole artikli 1 lõikes 1 osutatud kombineeritud tehing. |

TÄIENDAVA VIIVITUSE MÄRGISED

| | | | | |
|---|--------|--|--|--|
| Artikli 11 lõike 1 punkti a alapunkt i | „LMTF“ | Piiratud andmete märgis | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Esimeses aruandes avalikustatakse piiratud andmed kooskõlas artikli 11 lõike 1 punkti a alapunktiga i. |
| | „FULF“ | Täielike andmete märgis | | Tehingud, mille piiratud andmed on varem avalikustatud kooskõlas artikli 11 lõike 1 punkti a alapunktiga i. |
| Artikli 11 lõike 1 punkti a alapunkt ii | „DATF“ | Päevaste tehingute koondandmete märgis | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Päevaste tehingute koondandmete avalikustamine kooskõlas artikli 11 lõike 1 punkti a alapunktiga ii. |
| | „FULA“ | Täielike andmete märgis | | Üksikud tehingud, mille koondandmed on varem avalikustatud kooskõlas artikli 11 lõike 1 punkti a alapunktiga ii. |

| | | | | |
|--|--------|---|--|--|
| Artikli 11 lõike 1 punkt b | „VOLO“ | Mahu ärajätmise märgis | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Tehing, mille piiratud andmed avalikustatakse kooskõlas artikli 11 lõike 1 punktiga b. |
| | „FULV“ | Täielike andmete märgis | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Tehing, mille piiratud andmed on varem avalikustatud kooskõlas artikli 11 lõike 1 punktiga b. |
| Artikli 11 lõike 1 punkt c | „FWAF“ | Nelja nädala koondandmete märgis | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Tehingute koondandmete avalikustamine kooskõlas artikli 11 lõike 1 punktiga c. |
| | „FULJ“ | Täielike andmete märgis | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Üksikud tehingud, mille puhul on varem lubatud kasutada koondandmete avaldamist kooskõlas artikli 11 lõike 1 punktiga c. |
| Artikli 11 lõike 1 punkt d | „IDAF“ | Määramata aja jooksul koondandmete esitamise märgis | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Tehingud, mille puhul on lubatud mitme tehingu avalikustamine kokkuvõtlikul kujul määramata aja jooksul kooskõlas artikli 11 lõike 1 punktiga d. |
| Artikli 11 lõike 1 punkti b ja lõike 2 punkti c järjestikune kasutamine riigi võlakohustuste puhul | „VOLW“ | Mahu ärajätmise märgis | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Tehing, mille puhul avalikustatakse piiratud andmed kooskõlas artikli 11 lõike 1 punktiga b ja mille puhul lubatakse järgnevalt mitme tehingu avalikustamist kokkuvõtlikul kujul määramata aja jooksul kooskõlas artikli 11 lõike 2 punktiga c. |
| | „COAF“ | Järjestikuse koondandmete esitamise märgis (kauplemisjärgne mahu ärajätmine riigi võlakohustuste puhul) | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Tehingud, mille puhul on varem avalikustatud piiratud andmed kooskõlas artikli 11 lõike 1 punktiga b ja mille puhul on järgnevalt lubatud mitme tehingu avalikustamine kokkuvõtlikul kujul määramata aja jooksul kooskõlas artikli 11 lõike 2 punktiga c.“ |

3) Tabel 4 asendatakse järgmisega:

„Tabel 4

Mahu mõõtmise

| Instrumendi liik | Maht |
|--|--|
| Kõik võlakirjad, v.a börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad ning struktureeritud finantstooted | Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10. |
| Börsil kaubeldavate kaupade ja börsil kaubeldavate võlakirjade liigid | Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10. |
| Väärtpaberistatud tuletisinstrumendid | Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10. |
| Intressimäära tuletisinstrumendid | Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10. |

| Instrumendi liik | Maht |
|---|--|
| Välisvaluuta tuletisinstrumendid | Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10. |
| Aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid | Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10. |
| Kauba tuletisinstrumendid | Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10. |
| Krediitituletisinstrumendid | Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10. |
| Hinnavaheleping | Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10. |
| C10 tuletisinstrumendid | Kaubeldava lepingu tinglik väärtus vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 10. |
| Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumendid | Kogus mõõtühikutes vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 8. |
| Lubatud heitkoguste väärtpaberid | Kogus mõõtühikutes vastavalt käesoleva määruse II lisa tabeli 2 lahtrile 8.“. |

III lisa muudetakse järgmiselt.

1) 1. osas asendatakse punkt 13 järgmisega:

„13. „Vahetusoptioon“ või „vahetustehingu optioon“ tähendab optioonilepingut, mis annab omanikule õiguse, aga ei pane kohustust sõlmida vahetustehing teataval tulevasel kuupäeval või kuni sellise kuupäevani.“

2) Tabel 2.2 asendatakse järgmisega:

„Tabel 2.2

Võlakirjad (kõik võlakirjaliigid, v.a börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad) – klassid, millel ei ole likviidset turgu

| Varaklass – võlakirjad (kõik võlakirjaliigid, v.a börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad) | | | |
|---|---|---------------------------|---------------|
| Iga üksiku võlakirja puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu artikli 13 lõike 18 kohaselt, kui seda iseloomustab teatav võlakirjaliigi ja emissioonimahu kombinatsioon, mis on täpsustatud igal tabeli real. | | | |
| Võlakirjaliik | | Emissioonimaht – RTS23#14 | |
| Riigivõlakiri RTS2#3 = BOND ja RTS2#9 = EUSB | Võlakiri, mis ei ole vahetusvõlakiri ega pandikiri ja mille on emiteerinud avaliku sektori emitent: a. liit; b. liikmesriik, k.a liikmesriigi valitsusasutus, amet või eriotstarbeline üksus; c. riigi üksus, mis ei ole loetletud punktides a ja b. | vähem kui (EUR) | 1 000 000 000 |

| Varaklass – võlakirjad (kõik võlakirjaliigid, v.a börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad) | | | |
|---|---|---------------------------|---------------|
| Võlakirjaliik | | Emissioonimaht – RTS23#14 | |
| Muu avaliku sektori võlakiri RTS2#3 = BOND ja RTS2#9 = OEPP | Võlakiri, mis ei ole vahetusvõlakiri ega pandikiri ja mille on emiteerinud mõni järgmistest avalik-õiguslikest emitentidest: a. liitriigist liikmesriigi puhul liitriigi liige; b. mitme liikmesriigi eriotstarbeline üksus; c. rahvusvaheline finantsasutus, mille on asutanud vähemalt kaks liikmesriiki ja mille eesmärk on koondada rahalisi vahendeid ning anda rahalist abi oma liikmetele, kellel on või keda ohustavad ulatuslikud finantsprobleemid; d. Euroopa Investeerimispank; e. avaliku sektori asutus, mis ei ole riigivõlakirja emitent, nagu on täpsustatud eelmisel real. | vähem kui (EUR) | 500 000 000 |
| Vahetusvõlakiri RTS2#3 = BOND ja RTS2#9 = CVTB | Instrument, mis koosneb võlakirjast või väärtpaberistatud võlainstrumentidest koos varjatud tuletisinstrumentidega, nt optioon osta alusaktsia | vähem kui (EUR) | 500 000 000 |
| Pandikiri RTS2#3 = BOND ja RTS2#9 = CVDB | Võlakirjad, millele on osutatud direktiivi 2009/65/EÜ artikli 52 lõikes 4 | etappides S1 ja S2 | |
| | | vähem kui (EUR) | 1 000 000 000 |

| Varaklass – võlakirjad (kõik võlakirjaliigid, v.a börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad) | | | | | |
|---|---|---------------------------|---------------|--------------------|-------------|
| Võlakirjaliik | | Emissioonimaht – RTS23#14 | | | |
| | | etappides S1 ja S2 | | etappides S3 ja S4 | |
| Äriühingu võlakiri RTS2#3 = BOND ja RTS2#9 = CRPB | Võlakiri, mis ei ole vahetusvõlakiri ega pandikiri ja mille on emiteerinud Euroopa äriühing, mis on asutatud kooskõlas nõukogu määrusega (EÜ) nr 2157/2001 ⁽¹⁾ , või Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2013/34/EL ⁽²⁾ I või II lisas loetletud liiki äriühing või samaväärne äriühing kolmandates riikides | vähem kui (EUR) | 1 000 000 000 | vähem kui (EUR) | 500 000 000 |
| Võlakirjaliik | Selliste finantsinstrumentide kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 13 lõike 18 järgi, kasutatakse järgmist meetodikat | | | | |
| Muu võlakiri RTS2#3 = BOND ja RTS2#9 = OTHR | Võlakirja, mis ei kuulu ühegi eespool nimetatud võlakirjaliigi alla, käsitatakse likviidset turgu mitteomavana | | | | |

⁽¹⁾ Nõukogu 8. oktoobri 2001. aasta määrus (EÜ) nr 2157/2001 Euroopa äriühingu (SE) põhikirja kohta (EÜT L 294, 10.11.2001, lk 1).

⁽²⁾ Euroopa Parlamendi ja nõukogu 26. juuni 2013. aasta direktiiv 2013/34/EL teatavat liiki ettevõtjate aruandeaasta finantsaruannete, konsolideeritud finantsaruannete ja nendega seotud aruannete kohta ja millega muudetakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2006/43/EÜ ning tunnistatakse kehtetuks nõukogu direktiivid 78/660/EMÜ ja 83/349/EMÜ (ELT L 182, 29.6.2013, lk 19).“

3) Tabel 2.4 asendatakse järgmisega:

„Tabel 2.4

Võlakirjad (börsil kaubeldavate kaupade ja börsil kaubeldavate võlakirjade liiki võlakirjad) – klassid, millel ei ole likviidset turgu

| Võlakirjaliik | Iga üksiku finantsinstrumendi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest | |
|--|--|---|
| | Keskmine päevakäive [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| <p>Börsil kaubeldavad kaubad – RTS2#3 = ETCS</p> <p>Võlainstrument, mis on emiteeritud otseinvesteeringu vastu, mille emitent on teinud kaupadesse või kauba tuletislepingutesse. Börsil kaubeldava kauba hind on otse või kaudselt seotud alusvara tootlusega. Börsil kaubeldav kaup kajastab passiivselt selle kauba või kauba indeksi tootlust, millega ta seotud on.</p> | 500 000 eurot | 10 |
| <p>Börsil kaubeldavad võlakirjad – RTS2#3 = ETNS</p> <p>Võlainstrument, mis on emiteeritud otseinvesteeringu vastu, mille emitent on teinud alusvarasse või aluseks olevatesse tuletislepingutesse. Börsil kaubeldava võlakirja hind on otse või kaudselt seotud alusvara tootlusega. Börsil kaubeldav võlakiri kajastab passiivselt selle alusvara tootlust, millega ta seotud on.</p> | 500 000 eurot | 10“ |

4) Tabel 3.1 asendatakse järgmisega:

„Tabel 3.1

Struktureeritud finantstooted – klassid, millel ei ole likviidset turgu

| Varaklass – struktureeritud finantstooted | | |
|---|--|--|
| 1. test – struktureeritud finantstootete varaklassi hindamine | | |

Struktureeritud finantstootete varaklassi hindamine selliste finantsinstrumentide kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi – RTS2#3 = SFPS

| Tehingud, mida võetakse arvesse kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumidega seotud väärtuste arvutamisel, et hinnata struktureeritud finantstootete varaklassi | Struktureeritud finantstootete varaklassi hinnatakse, kohaldades järgmisi kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künniseid | |
|---|--|---|
| | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| Kõikide struktureeritud finantstootetega tehtud tehingud | 300 000 000 eurot | 500 |

| 2. test – struktureeritud finantstooted, millel ei ole likviidset turgu | | |
|---|--|--|
|---|--|--|

Kui kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumidega seotud väärtused ületavad mõlemad kvantitatiivseid likviidsuse künniseid, mis on kehtestatud struktureeritud finantstootete varaklassi hindamise eesmärgil, siis on 1. test läbitud ja tuleb teha 2. test. Iga üksiku finantsinstrumendi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest

| Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Nende päevade hulk protsentides, mille jooksul asjaomasel perioodil kaubeldi [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 3] |
|---|---|---|
| 100 000 eurot | 2 | 80 % |

5) Tabel 4.1 asendatakse järgmisega:

„Tabel 4.1

Väärtpaberistatud tuletisinstrumentid – klassid, millel ei ole likviidset turgu

Varaklass – väärtpaberistatud tuletisinstrumentid

Vabalt võõrandatavad väärtpaberid, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL artikli 4 lõike 1 punkti 44 alapunktis c, mis erinevad struktureeritud finantstoodetest ja hõlmavad vähemalt järgmist:

- a.1) kaetud lihtostutähed (*plain vanilla covered warrants*) – finantsasutuse emiteeritud väärtpaberid, mis annavad omanikule õiguse, aga ei pane kohustust
 - a) osta aegumistähtajal või aegumistähtajaks teatavas koguses alusvara eelnevalt kindlaks määratud täitmishinnaga või juhul, kui sularahas arveldus on fikseeritud, siis saama hetke turuhinna ja täitmishinna positiivse vahe makse, või
 - b) müüa aegumistähtajal või aegumistähtajaks teatavas koguses alusvara eelnevalt kindlaks määratud täitmishinnaga või juhul, kui sularahas arveldus on fikseeritud, saama täitmishinna ja hetke turuhinna positiivse vahe makse ostjalt;
- a.2) ostutähed (*warrants*) – sama alusvaraemitendi emiteeritud väärtpaberid, mis annavad omanikule õiguse, aga ei pane kohustust
 - a) osta aegumistähtajal või aegumistähtajaks teatavas koguses alusvara eelnevalt kindlaks määratud täitmishinnaga või juhul, kui sularahas arveldus on fikseeritud, siis saama hetke turuhinna ja täitmishinna positiivse vahe makse, või
 - b) müüa aegumistähtajal või aegumistähtajaks teatavas koguses alusvara eelnevalt kindlaks määratud täitmishinnaga või juhul, kui sularahas arveldus on fikseeritud, saama täitmishinna ja hetke turuhinna positiivse vahe makse ostjalt;
- b) finantsvõimenduse tunnistused (*leverage certificates*) – tunnistused, mis kajastavad alusvara tootlust koos finantsvõimenduse mõjuga;
- c) eksootilised kaetud ostutähed (*exotic covered warrants*) – kaetud ostutähed, mille põhikomponent on optioonide kombinatsioon;
- d) kaubeldavad õigused, mille alusvara on mittekapitaliinstrument;
- e) investeerimistunnistused – tunnistused, mis kajastavad alusvara tootlust ilma finantsvõimenduse mõjuta.

RTS2#3 = SDRV

Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat

Kõiki väärtpaberistatud tuletisinstrumente käsitatakse likviidset turgu omavana“.

6) Tabel 5.1 asendatakse järgmisega:

„Tabel 5.1

Intressimäära tuletisinstrumendid – klassid, millel ei ole likviidset turgu

| Varaklass – intressimäära tuletisinstrumendid | | | |
|---|--|--|--|
|---|--|--|--|

Mis tahes leping, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktis 4, mille lõplik alusvara on intressimäär, võlakiri, laen; mis tahes korv, portfell või indeks, mis hõlmab intressimäära, võlakirja, laenu, või muu toode, mis esindab intressimäära, võlakirja või laenu tootlust.

| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
|---|---|---|---|--|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium |
| Võlakirjafutuurid/-forvardid / võlakirjafutuuuri futuur / võlakirjafutuuuri forvard | Võlakirjafutuuuri/-forvardi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS2#17) – alusvara emitent Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#18) – alusvaraks oleva ülekantava võlakirja tähtaeg on määratletud järgmiselt: Lühiajaline: alusvaraks olev ülekantav võlakiri tähtajaga kuni 4 aastat loetakse lühiajaliseks Keskmise tähtajaga: alusvaraks olev ülekantav võlakiri tähtajaga 4–8 aastat loetakse keskmise tähtajaga võlakirjaks | 5 000 000 eurot | 10 | Kui alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel on likviidne turg teatava järelejäänud tähtaja klassi puhul, ja alamklassi puhul, mis on määratletud järgmise järelejäänud tähtaja klassiga, määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu, määratakse esimese järgneva lepingu (<i>back month</i>) puhul kindlaks, et sellel on likviidne turg, kaks nädalat enne kehtiva lepingu (<i>front month</i>) lõppu |
| Võlakirjafutuur RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FUTR RTS2#16 = BOND või | | | | |

| Varade alamklass | Selleste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
|--|--|---|---|---|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium |
| <p>Võlakirjaforvard</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = FORW</p> <p>RTS2#16 = BOND</p> <p>või</p> <p>Võlakirjafutuuri futuur</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = FUTR</p> <p>RTS2#16 = BNFD</p> <p>või</p> <p>Võlakirjafutuuri forvard</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = FORW</p> <p>RTS2#16 = BNFD</p> | <p>Pikaajaline: alusvaraks olev ülekantav võlakiri tähtajaga 8–15 aastat loetakse pikaajaliseks</p> <p>Väga pikaajaline: alusvaraks olev ülekantav võlakiri tähtajaga rohkem kui 15 aastat loetakse väga pikaajaliseks</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 3 – futuuri järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 2: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 4: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 5: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | | | |

| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
|--|--|---|---|---|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium |
| Võlakirjaoptsoon / võlakirjaoptsooni optsoon / võlakirjafutuuri optsoon Võlakirjaoptsoon Võlakirjaoptsooni optsoon RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = OPTN RTS2#16 = BOND või Võlakirjaoptsooni optsoon RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = OPTN RTS2#16 = BOND või Võlakirjafutuuri optsoon RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = OPTN RTS2#16 = BNF | <p>Võlakirjaoptsooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS2#22) – lõplik alusvaraks olev võlakiri</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – optsooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 2: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 4: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 5: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | 5 000 000 eurot | 10 | |

| Varade alamklass | Selleste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
|---|--|---|---|--|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium |
| Intressimäärafutuuriid ja intressiforvardid / intressimäärafutuuri futuur / intressimäärafutuuri intressiforvard Intressimäärafutuuri RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FUTR RTS2#16 = INTR või Intressiforvard RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FRAS RTS2#16 = INTR või Intressimäärafutuuri futuur RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FUTR RTS2#16 = IFUT või Intressimäärafutuuri intressiforvard RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FRAS RTS2#16 = IFUT | Intressimäärafutuuri alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS2#24) – aluseks olev intressimäär Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#25) – aluseks oleva intressimäära tähtaeg Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#8) – futuuri järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud Tähtajaklass 2: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud Tähtajaklass 3: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta Tähtajaklass 4: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat Tähtajaklass 5: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat ... Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat | 500 000 000 eurot | 10 | Kui alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel on likviidne turg teatava järelejäänud tähtaja klassi puhul, ja alamklassi puhul, mis on määratletud järgmise järelejäänud tähtaja klassiga, määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu, määratakse esimese järgneva lepingu (back month) puhul kindlaks, et sellel on likviidne turg, kaks nädalat enne kehtiva lepingu (front month) lõppu |

| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
|--|--|---|---|---|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium |
| Intressimääraoptsoonid / intressimäärafutuuri/intressiforvardi optsoon / intressimääraoptsooni optsoon / intressimäärafutuuri/intressiforvardi optsooni optsoon Intressimäärafutuuri/intressiforvardi optsoon // Intressimääraoptsooni optsoon RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = OPTN RTS2#16 = IFUT või Intressimääraoptsoon // Intressimäärafutuuri/intressiforvardi optsooni optsoon RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = OPTN RTS2#16 = INTR | Intressimääraoptsooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS2#24) – aluseks olev intressimäär Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#25) – aluseks oleva intressimäära tähtaeg Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#8) – optsooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud Tähtajaklass 2: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud Tähtajaklass 3: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta Tähtajaklass 4: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat Tähtajaklass 5: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat ... Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat | 500 000 000 eurot | 10 | |

| Varade alamklass | Selleste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
|--|--|---|---|---|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium |
| Vahetusoptsioonid RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWPT | <p>Vahetusoptsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi:</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS2#16) – aluseks oleva vahetustehingu liik on määratletud järgmiselt: ühes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingud, ühes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid [RTS2#16 = XXSC]</p> <p>ühes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud, ühes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid [RTS2#16 = XFSC]</p> <p>ühes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud, ühes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid [RTS2#16 = FFSC]</p> <p>ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingud, ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forvardid [RTS2#16 = IFSC]</p> <p>ühes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingud, ühes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingute futuurid/forvardid [RTS2#16 = OSSC]</p> <p>mitmes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingud, mitmes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid [RTS2#16 = XXMC]</p> <p>mitmes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud, mitmes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid [RTS2#16 = XFMC]</p> | 500 000 000 eurot | 10 | |

| Varade alamklass | Selleste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
|------------------|---|---|---|---|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium |
| | <p>mitmes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud, mitmes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid [RTS2#16 = FPMC]</p> <p>mitmes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingud, mitmes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forvardid [RTS2#16 = IFMC]</p> <p>mitmes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingud, mitmes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingute futuurid/forvardid [RTS2#16 = OSMC]</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#20) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles optiooni tinglik väärtus on nomineeritud</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#22 või RTS2#23) – inflatsiooniindeks, kui aluseks olev vahetustehing on kas ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehing või mitmes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehing</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 4 (RTS2#21) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ kuu</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ kuu} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud</p> | | | |

| Varade alamklass | Selleste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
|------------------|---|---|---|---|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium |
| | <p>Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</p> <p>Tähtajaklass 5: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</p> <p>Tähtajaklass 6: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: (n - 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 5 (RTS2#8) – optiooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud</p> <p>Tähtajaklass 2: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</p> <p>Tähtajaklass 3: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</p> <p>Tähtajaklass 4: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 5 aastat</p> <p>Tähtajaklass 5: 5 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 10 aastat</p> <p>Tähtajaklass 6: üle 10 aasta</p> | | | |

| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
|--|--|---|---|---|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium |
| <p>Mitmes valuutas või erinevates valuutades fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid/optioonid</p> <p>Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forvard/optioon, mille kaks poolt vahetavad eri valuutades nomineeritud rahavooge ning ühe poole rahavood on määratud kindlaks fikseeritud intressimääraga ja teise poole rahavood ujuva intressimääraga.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS</p> <p>RTS2#16 = XFMC</p> | <p>Mitmes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#13 ja RTS23#42) – tinglike valuutade paar, mis on määratletud kui kahe sellise valuuta kombinatsioon, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ kuu</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ kuu} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 4: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 5: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 6: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | 50 000 000 eurot | 10 | |

| Varade alamklass | Selleste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
|--|---|---|---|---|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium |
| <p>Mitmes valuutas või erinevates valuutades ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forwardid/optioonid</p> <p>Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forward/optioon, mille kaks poolt vahetavad eri valuutades nomineeritud rahavooge ja mõlema poole rahavood on määratud kindlaks ujuva intressimääraga</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS</p> <p>RTS2#16 = FFMC</p> | <p>Mitmes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmistest segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#13 ja RTS23#42) – tinglike valuutade paar, mis on määratletud kui kahe sellise valuuta kombinatsioon, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ kuu</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ kuu} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 4: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 5: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 6: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | 50 000 000 eurot | 10 | |

| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
|--|---|---|---|---|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium |
| <p>Mitmes valuutas või erinevates valuutades fikseeritud-määr-fikseeritud-määravastu-vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades fikseeritud-määr-fikseeritud-määravastu-vahetustehingute futuurid/forvardid/optioonid</p> <p>Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forvard/optioon, mille kaks poolt vahetavad eri valuutades nomineeritud rahavooge ja mõlema poole rahavood on määratud kindlaks fikseeritud intressimääraga</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS</p> <p>RTS2#16 = XXMC</p> | <p>Mitmes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määravastu-vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#13 ja RTS23#42) – tinglike valuutade paar, mis on määratletud kui kahe sellise valuuta kombinatsioon, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ kuu</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ kuu} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 4: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 5: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 6: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | 50 000 000 eurot | 10 | |

| Varade alamklass | Selleste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
|---|---|---|---|---|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium |
| <p>Mitmes valuutas või erinevates valuutades üleöö intressimäära vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades üleöö intressimäära vahetustehingute futuurid/forvardid/optioonid</p> <p>Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forvard/optioon, mille kaks poolt vahetavad eri valuutades nomineeritud rahavooge ja vähemalt ühe poole rahavood on määratud kindlaks üleöö intressimäära vahetustehingu intressimääraga</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS</p> <p>RTS2#16 = OSMC</p> | <p>Mitmes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#13 ja RTS23#42) – tinglike valuutade paar, mis on määratletud kui kahe sellise valuuta kombinatsioon, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ kuu</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ kuu} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 4: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 5: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 6: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | 50 000 000 eurot | 10 | |

| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
|--|--|---|---|---|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium |
| <p>Mitmes valuutas või erinevates valuutades inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingud ning mitmes valuutas või erinevates valuutades inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forwardid/optioonid</p> <p>Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forward/optioon, mille kaks poolt vahetavad eri valuutades nomineeritud rahavooge ja vähemalt ühe poole rahavood on määratud kindlaks inflatsioonimääraga</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS</p> <p>RTS2#16 = IFMC</p> | <p>Mitmes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#13 ja RTS23#42) – tinglike valuutade paar, mis on määratletud kui kahe sellise valuuta kombinatsioon, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ kuu</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ kuu} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 4: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 5: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 6: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | 50 000 000 eurot | 10 | |

| Varade alamklass | Selleste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitletakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
|---|---|---|---|---|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium |
| <p>Ühes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud ja ühes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid/optioonid</p> <p>Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forvard/optioon, mille kaks poolt vahetavad samas valuutas nomineeritud rahavooge ning ühe poole rahavood on määratud kindlaks fikseeritud intressimääraga ja teise poole rahavood ujuva intressimääraga</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS</p> <p>RTS2#16 = XFSC</p> | <p>Ühes valuutas fikseeritud-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmistest segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#13) – tinglik valuuta, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ kuu</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ kuu} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 4: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 5: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 6: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | 50 000 000 eurot | 10 | |

| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
|--|--|---|---|---|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium |
| <p>Ühes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingud ja ühes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid/optioonid</p> <p>Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forvard/optioon, mille kaks poolt vahetavad samas valuutas nomineeritud rahavooge ja mõlema poole rahavood on määratud kindlaks ujuva intressimääraga</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS</p> <p>RTS2#16 = FFSC</p> | <p>Ühes valuutas ujuv-määr-ujuva-määra-vastu-vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#13) – tinglik valuuta, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ kuu</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ kuu} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 4: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 5: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 6: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | 50 000 000 eurot | 10 | |

| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
|--|---|---|---|---|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium |
| <p>Ühes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingud ja ühes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingute futuurid/forvardid/optioonid</p> <p>Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forvard/optioon, mille kaks poolt vahetavad samas valuutas nomineeritud rahavooge ja mõlema poole rahavood on määratud kindlaks fikseeritud intressimääraga</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS</p> <p>RTS2#16 = XXSC</p> | <p>Ühes valuutas fikseeritud-määr-fikseeritud-määra-vastu-vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#13) – tinglik valuuta, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ kuu</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ kuu} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 4: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 5: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 6: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | 50 000 000 eurot | 10 | |

| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
|---|--|---|---|---|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium |
| <p>Ühes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingud ja ühes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingute futuurid/forvardid/optsoonid</p> <p>Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forvard/optsoon, mille kaks poolt vahetavad samas valuutas nomineeritud rahavooge ja vähemalt ühe poole rahavood on määratud kindlaks üleöö intressimäära vahetustehingu intressimääraga</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS</p> <p>RTS2#16 = OSSC</p> | <p>Ühes valuutas üleöö intressimäära vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#13) – tinglik valuuta, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ kuu</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ kuu} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 4: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 5: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 6: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | 50 000 000 eurot | 10 | |

| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitletakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
|--|---|---|---|---|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium |
| <p>Ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingud ja ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forwardid/optioonid</p> <p>Vahetustehing või vahetustehingu futuur/forward/optioon, mille kaks poolt vahetavad samas valuutas nomineeritud rahavooge ja vähemalt ühe poole rahavood on määratud kindlaks inflatsioonimääraga</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP või FONS või FWOS või OPTS</p> <p>RTS2#16 = IFSC</p> | <p>Ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#13) – tinglik valuuta, milles vahetustehingu kaks poolt on nomineeritud</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ kuu</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ kuu} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 4: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 5: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 6: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | 50 000 000 eurot | 10 | |

| Varaklass – intressimäära tuletisinstrumentid | |
|---|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kasutatakse järgmist metoodikat |
| <p>Muud intressimäära tuletisinstrumentid</p> <p>Intressimäära tuletisinstrument, mis ei kuulu ühessegi ülalnimetatud varade alamklassi</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = OTHR</p> | <p>Mis tahes muud intressimäära tuletisinstrumenti käsitatakse likviidset turgu mitteomavana“.</p> |

7) Tabel 6.1 asendatakse järgmisega:

„Tabel 6.1

Aktsiatel põhinevad tuletisinstrumentid – klassid, millel ei ole likviidset turgu

| Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumentid |
|---|
|---|

Mis tahes leping, mis on määratletud direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktis 4 ja mis on seotud:

- ühe või mitme aktsiaga, hoidmistunnistustega, börsil kaubeldavate fondidega, sertifikaatidega, muude sarnaste finantsinstrumentidega, rahavoogudega või muude toodetega, mis on seotud ühe või mitme aktsia, hoidmistunnistuste, börsil kaubeldavate fondide, sertifikaatide või muude sarnaste finantsinstrumentide tootlusega;
- aktsiate, hoidmistunnistuste, börsil kaubeldavate fondide, sertifikaatide, muude sarnaste finantsinstrumentide, rahavoogude või muude selliste toodete indeksiga, mis on seotud ühe või mitme aktsia, hoidmistunnistuste, börsil kaubeldavate fondide, sertifikaatide või muude sarnaste finantsinstrumentide tootlusega.

| Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid | |
|---|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat |
| <p>Aktsiaindeksiopsioonid</p> <p>Opsioon, mille aluseks on aktsiatest koosnev indeks</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = STIX</p> <p>RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28</p> | Kõiki indeksiopsioone käsitatakse likviidset turgu omavana |
| <p>Aktsiaindeksifutuurid/-forvardid</p> <p>Futuur/forvard, mille aluseks on aktsiatest koosnev indeks</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR või FORW</p> <p>RTS2#27 = STIX</p> <p>RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28</p> | Kõiki indeksifutuure/-forvardeid käsitatakse likviidset turgu omavana |
| <p>Aktsiaopsioonid</p> <p>Opsioon, mille aluseks on aktsia või aktsiakorv, mis tuleneb korporatiivsest sündmusest</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = SHRS</p> <p>RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28</p> | Kõiki aktsiaopsioone käsitatakse likviidset turgu omavana |

| Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid | |
|---|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat |
| <p>Aktsiafutuudid/-forvardid</p> <p>Futuur/forward, mille aluseks on aktsia või aktsiakorv, mis tuleneb korporatiivsest sündmusest</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR või FORW</p> <p>RTS2#27 = SHRS</p> <p>RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28</p> | <p>Kõiki aktsiafutuude/-forvardeid käsitatakse likviidset turgu omavana</p> |
| <p>Aktsiadividendioptsioonid</p> <p>Teatava aktsia dividendi optsoon</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = DVSE</p> <p>RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28</p> | <p>Kõiki aktsiadividendioptsoone käsitatakse likviidset turgu omavana</p> |
| <p>Aktsiadividendifutuudid/-forvardid</p> <p>Teatava aktsia dividendi futuur/forward</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR või FORW</p> <p>RTS2#27 = DVSE</p> <p>RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28</p> | <p>Kõiki aktsiadividendifutuude/-forvardeid käsitatakse likviidset turgu omavana</p> |

| Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid | |
|--|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat |
| <p>Dividendiindeksioptionid</p> <p>Rohkem kui ühe aktsia dividendidest koosneva indeksi option</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = DIVI</p> <p>RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28</p> | <p>Kõiki dividendiindeksioptione käsitatakse likviidset turgu omavana</p> |
| <p>Dividendiindeksifutuurid/-forvardid</p> <p>Rohkem kui ühe aktsia dividendidest koosneva indeksi futuur/forvard</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR või FORW</p> <p>RTS2#27 = DIVI</p> <p>RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28</p> | <p>Kõiki dividendiindeksifutuuere/-forvardeid käsitatakse likviidset turgu omavana</p> |
| <p>Volatiilsusindeksioptionid</p> <p>Option, mille aluseks on volatiilsusindeks, mis on määratletud kui teatava aluseks oleva kapitaliinstrumentide indeksiga seotud volatiilsuse indeks</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = VOLI</p> <p>RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28</p> | <p>Kõiki volatiilsusindeksioptione käsitatakse likviidset turgu omavana</p> |

| Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid | |
|--|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat |
| <p>Volatiilsusindeksifutuurid/-forvardid</p> <p>Futuur/forvard, mille aluseks on volatiilsusindeks, mis on määratletud kui teatava aluseks oleva kapitaliinstrumentide indeksiga seotud volatiilsuse indeks</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR või FORW</p> <p>RTS2#27 = VOLI</p> <p>RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28</p> | <p>Kõiki volatiilsusindeksifutuuere/-forvardeid käsitatakse likviidset turgu omavana</p> |
| <p>Börsil kaubeldavate fondide optioonid</p> <p>Optioon, mille alusvara on börsil kaubeldav fond</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = ETFS</p> <p>RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28</p> | <p>Kõiki börsil kaubeldavate fondide optioone käsitatakse likviidset turgu omavana</p> |
| <p>Börsil kaubeldavate fondide futuurid/forvardid</p> <p>Futuur/forvard, mille alusvara on börsil kaubeldav fond</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR või FORW</p> <p>RTS2#27 = ETFS</p> <p>RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28</p> | <p>Kõiki börsil kaubeldavate fondide futuuere/forvardeid käsitatakse likviidset turgu omavana</p> |

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid

| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitte-omavana vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud | allpool | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|--|---|---|--|---|--|---|--|---|--|---|--|---|--|--|-----|--|--|
| | | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | | | | | | | | | | | | | | | |
| Vahetustehingud RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUIT RTS2#5 = SWAP | Vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi: Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS2#27) – alusvara liik: üks alusvara, indeks, korv Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28) – aluseks on üks alusvara, indeks, korv Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#28) – parameeter: hinna ja tulususe näitaja põhiparameeter (<i>price return basic performance parameter</i>), dividendi tulususe parameeter (<i>parameter return dividend</i>), tulususe variatsiooni parameeter (<i>parameter return variance</i>), tulususe volatiilsuse parameeter (<i>parameter return volatility</i>) Segmenteerimiskriteerium 4 (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: | 50 000 000 eurot | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | <table border="1"> <tr> <td>Hinna ja tulususe näitaja põhiparameeter (<i>price return basic performance parameter</i>)</td> <td>Tulususe variatsiooni/volatiilsuse parameeter (<i>parameter return variance/volatility</i>)</td> <td>Dividendi tulususe parameeter (<i>parameter return dividend</i>)</td> </tr> <tr> <td>Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu</td> <td>Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud</td> <td>Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td> </tr> <tr> <td>Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud</td> <td>Tähtajaklass 2: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud</td> <td>Tähtajaklass 2: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</td> </tr> <tr> <td>Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud</td> <td>Tähtajaklass 3: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td> <td>Tähtajaklass 3: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat</td> </tr> <tr> <td>Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td> <td>Tähtajaklass 4: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</td> <td>...</td> </tr> </table> | Hinna ja tulususe näitaja põhiparameeter (<i>price return basic performance parameter</i>) | Tulususe variatsiooni/volatiilsuse parameeter (<i>parameter return variance/volatility</i>) | Dividendi tulususe parameeter (<i>parameter return dividend</i>) | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud | Tähtajaklass 2: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud | Tähtajaklass 2: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud | Tähtajaklass 3: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | Tähtajaklass 3: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat | Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | Tähtajaklass 4: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | ... | | |
| Hinna ja tulususe näitaja põhiparameeter (<i>price return basic performance parameter</i>) | Tulususe variatsiooni/volatiilsuse parameeter (<i>parameter return variance/volatility</i>) | Dividendi tulususe parameeter (<i>parameter return dividend</i>) | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud | Tähtajaklass 2: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud | Tähtajaklass 2: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud | Tähtajaklass 3: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | Tähtajaklass 3: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | Tähtajaklass 4: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | ... | | | | | | | | | | | | | | | | |

Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid

| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitte-omavana vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud | | | allpool | |
|---|--|---|---|--|--|
| | | | | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| | Tähtajaklass 5: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | Tähtajaklass 5: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | | |
| | Tähtajaklass 6: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat | ... | | | |
| | ... | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | | | |
| | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | | | | |
| Portfellivahetustehingud RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQU RTS2#5 = PSWP | Portfellivahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmise spetsiifilise kombinatsiooni alusel. Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS2#27) – alusvara liik: üks alusvara, indeks, korv Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS23#26 või kui tühi, siis RTS23#28) – aluseks on üks alusvara, indeks, korv Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#28) – parameeter: hinna ja tulususe näitaja põhiparameeter (<i>price return basic performance parameter</i>), dividendi tulususe parameeter (<i>parameter return dividend</i>), tulususe variatsiooni parameeter (<i>parameter return variance</i>), tulususe volatiilsuse parameeter (<i>parameter return volatility</i>) Segmenteerimiskriteerium 4 (RTS2#8) – portfellivahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud Tähtajaklass 3: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud Tähtajaklass 4: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta Tähtajaklass 5: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat Tähtajaklass 6: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat ... Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | | | 50 000 000 eurot | 15 |

| Varaklass – aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid | |
|---|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kasutatakse järgmist metoodikat |
| Muud aktsiatel põhinevad tuletisinstrumendid – aktsiatel põhinev tuletisinstrument, mis ei kuulu ühessegi ülalnimetatud varade alamklassi RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OTHR | Mis tahes muud aktsiatel põhinevat tuletisinstrumenti käsitatakse likviidset turgu mitteomavana“. |

8) Tabel 7.1 asendatakse järgmisega:

„Tabel 7.1

Kauba tuletisinstrumentid – klassid, millel ei ole likviidset turgu

| Varaklass – kauba tuletisinstrumentid | | | | | |
|--|--|--|---|--|----------------------------|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kunnistest | | | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | | |
| Metallide kaubafutuurid/-forvardid RTS2#3 = „DERV“ ja RTS2#4 = „COMM“ ning RTS23#35 = „METL“ ja [RTS2#5 = „FUTR“ või „FORW“] | Metalli kaubafutuuri/-forvardi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#36) – metalli liik: väärismetall, mitteväärismetall Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS23#37) – alusvaraks olev metall Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#15) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles futuuri/forvardi tinglik väärtus on nomineeritud Segmenteerimiskriteerium 4 (RTS2#8) – futuuri/forvardi järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: | 10 000 000 eurot | 10 | | |
| | <table border="1"> <tr> <td>Väärismetallid</td> <td>Mitteväärismetallid</td> </tr> </table> | | | Väärismetallid | Mitteväärismetallid |
| | Väärismetallid | | | Mitteväärismetallid | |
| | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud | | | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | |
| | Tähtajaklass 2: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | | | Tähtajaklass 2: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | |
| Tähtajaklass 3: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | Tähtajaklass 3: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat | | | | |

| Varaklass – kauba tuletisinstrumentid | | | | |
|---|---|---|--|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mittemoavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest | |
| | | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| | Tähtajaklass 4: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat | ... | | |
| | ... | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | | |
| | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | | | |
| Metallide kaubaopt-sioonid RTS2#3 = „DERV“ ja RTS2#4 = „COMM“ ning RTS23#35 = „METL“ ja RTS2#5 = „OPTN“ | Metalli kaubaoptiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#36) – metalli liik: väärismetall, mitteväärismetall Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS23#37) – alusvaraks olev metall Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#15) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles optiooni tinglik väärtus on nomineeritud Segmenteerimiskriteerium 4 (RTS2#8) – optiooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: | | 10 000 000 eurot | 10 |
| | Väärismetallid | Mitteväärismetallid | | |
| | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | | |
| | Tähtajaklass 2: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | Tähtajaklass 2: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | | |

| Varaklass – kauba tuletisinstrumentid | | | | |
|--|--|---|--|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mittemoavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest | |
| | | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| | Tähtajaklass 3: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | Tähtajaklass 3: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat | | |
| | Tähtajaklass 4: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat | ... | | |
| | ... | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | | |
| | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | | | |
| Metallide kaubavahetus- tehingud RTS2#3 = „DERV“ ja RTS2#4 = „COMM“ ning RTS23#35 = „METL“ ja RTS2#5 = „SWAP“ | Metalli kaubavahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#36) – metalli liik: väärismetall, mitteväärismetall Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS23#37) – alusvaraks olev metall Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#15) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles vahetustehingu tinglik väärtus on nomineeritud Segmenteerimiskriteerium 4 (RTS23#34) – tarne liik, mis on määratletud sularahas, füüsilise või valikulisena Segmenteerimiskriteerium 5 (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: | | 10 000 000 eurot | 10 |
| | Väärismetallid | Mitteväärismetallid | | |
| | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | | |

| Varaklass – kauba tuletisinstrumentid | | | | |
|--|--|---|--|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mittemovavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest | |
| | | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| | Tähtajaklass 2: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | Tähtajaklass 2: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | | |
| | Tähtajaklass 3: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | Tähtajaklass 3: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat | | |
| | Tähtajaklass 4: 2 aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 aastat | ... | | |
| | ... | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | | |
| | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | | | |
| Energia kaubafutuurid/-forvardid RTS2#3 = „DERV“ ja RTS2#4 = „COMM“ ning RTS23#35 = „NRGY“ ja [RTS2#5 = „FUTR“ või „FORW“] | Energia kaubafuturi/-forvardi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#36) – energialiik: nafta, nafta destillaadid, kivisüsi, kergfraktsioonid, maagaas, elekter, mitu energialiiki Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS23#37) – alusvaraks olev energia Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#15) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles futuuri/forvardi tinglik väärtus on nomineeritud Segmenteerimiskriteerium 4 – [välja jäetud] | | 10 000 000 eurot | 10 |

Varaklass – kauba tuletisinstrumentid

| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mittemoavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|--|--|---|------------------------------------|--|--|---|---|--|---|--|--|--|--|-----|-----|-----|---|---|---|--|--|--|--|
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | <p>Segmenteerimiskriteerium 5 (RTS2#14) – tarne / rahalise arvelduse koht, mis on asjakohane kõikide energialiikide puhul</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 6 (RTS2#8) – futuuri/forvardi järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | <table border="1"> <thead> <tr> <th>Nafta/destillaadid/kergraktsioonid</th> <th>Kivisüsi</th> <th>Maagaas/elekter/ mitu energialiiki</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 4 kuud</td> <td>Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud</td> <td>Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu</td> </tr> <tr> <td>Tähtajaklass 2: 4 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 8 kuud</td> <td>Tähtajaklass 2: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td> <td>Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td> </tr> <tr> <td>Tähtajaklass 3: 8 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</td> <td>Tähtajaklass 3: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</td> <td>Tähtajaklass 3: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</td> </tr> <tr> <td>Tähtajaklass 4: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</td> <td>...</td> <td>...</td> </tr> <tr> <td>...</td> <td>Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat</td> <td>Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat</td> </tr> <tr> <td>Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat</td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table> | Nafta/destillaadid/kergraktsioonid | Kivisüsi | Maagaas/elekter/ mitu energialiiki | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 4 kuud | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu | Tähtajaklass 2: 4 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 8 kuud | Tähtajaklass 2: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | Tähtajaklass 3: 8 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | Tähtajaklass 3: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | Tähtajaklass 3: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | Tähtajaklass 4: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | ... | ... | ... | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | | | | |
| Nafta/destillaadid/kergraktsioonid | Kivisüsi | Maagaas/elekter/ mitu energialiiki | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 4 kuud | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Tähtajaklass 2: 4 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 8 kuud | Tähtajaklass 2: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Tähtajaklass 3: 8 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | Tähtajaklass 3: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | Tähtajaklass 3: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Tähtajaklass 4: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | ... | ... | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ... | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| Varaklass – kauba tuletisinstrumentid | | | | | |
|---|--|--|---|------------------|----|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mittemoavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest | | | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | | |
| Energia kaubaoptioonid RTS2#3 = „DERV“ ja RTS2#4 = „COMM“ ning RTS23#35 = „NRGY“ ja RTS2#5 = „OPTN“ | Energia kaubaoptiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. | | | 10 000 000 eurot | 10 |
| | Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#36) – energialiik: nafta, nafta destillaadid, kivisüsi, kergfraktsioonid, maagaas, elekter, mitu energialiiki | | | | |
| | Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS23#37) – alusvaraks olev energia | | | | |
| | Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#15) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles optiooni tinglik väärtus on nomineeritud | | | | |
| | Segmenteerimiskriteerium 4 – [välja jäetud] | | | | |
| Segmenteerimiskriteerium 5 (RTS2#14) – tarne / rahalise arvelduse koht, mis on asjakohane kõikide energialiikide puhul | | | | | |
| Segmenteerimiskriteerium 6 (RTS2#8) – optiooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: | | | | | |
| | Nafta/destillaadid/kergfraktsioonid | Kivisüsi | Maagaas/elekter/ mitu energialiiki | | |
| | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 4 kuud | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu | | |
| | Tähtajaklass 2: 4 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 8 kuud | Tähtajaklass 2: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | | |
| | Tähtajaklass 3: 8 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | Tähtajaklass 3: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | Tähtajaklass 3: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | | |

| Varaklass – kauba tuletisinstrumentid | | | | | |
|---|---|--|--|--|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mittemoavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | | | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest | |
| | | | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| | Tähtajaklass 4: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | ... | ... | | |
| | ... | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | | |
| | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | | | | |
| Energia kaubavahetustehingud RTS2#3 = „DERV“ ja RTS2#4 = „COMM“ ning RTS23#35 = „NRGY“ ja RTS2#5 = „SWAP“ | <p>Energia kaubavahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#36) – energialiik: nafta, nafta destillaadid, kivisüsi, kergfraktsioonid, maagaas, elekter, mitu energialiiki</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS23#37) – alusvaraks olev energia</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#15) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles vahetustehingu tinglik väärtus on nomineeritud</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 4 (RTS23#34) – tarne liik, mis on määratletud sularahas, füüsilise või valikulisena</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 5 – [välja jäetud]</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 6 (RTS2#14) – tarne / rahalise arvelduse koht, mis on asjakohane kõikide energialiikide puhul</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 7 (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> | | | 10 000 000 eurot | 10 |

| Varaklass – kauba tuletisinstrumentid | | | | | |
|---|---|---|---|--|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mittemoavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | | | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest | |
| | | | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| | Nafta/destillaadid/kergraktsioonid | Kivisüsi | Maagaas/elekter/ mitu energialiiki | | |
| | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 4 kuud | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud | Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 kuu | | |
| | Tähtajaklass 2: 4 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 8 kuud | Tähtajaklass 2: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | Tähtajaklass 2: 1 kuu < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | | |
| | Tähtajaklass 3: 8 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta | Tähtajaklass 3: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | Tähtajaklass 3: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | | |
| | Tähtajaklass 4: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat | ... | ... | | |
| | ... | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | | |
| | Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | | | | |
| Põllumajandusliku kauba futuuriid/forvardid | Põllumajandusliku kauba futuuri/-forvardi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. | | | 10 000 000 eurot | 10 |
| RTS2#3 = „DERV“ ja RTS2#4 = „COMM“ ning RTS23#35 = „AGRI“ ja [RTS2#5 = „FUTR“ või „FORW“] | Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#36 ja RTS23#37) – alusvaraks olev põllumajanduslik kaup (alamtoode ja muu alamtoode) Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#15) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles futuuri/forvardi tinglik väärtus on nomineeritud | | | | |

| Varaklass – kauba tuletisinstrumentid | | | |
|---|--|--|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mittemoavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| | <p>Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#8) – futuuri/forvardi järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 2: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 4: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | | |
| <p>Põllumajandusliku kauba optioonid</p> <p>RTS2#3 = „DERV“ ja RTS2#4 = „COMM“ ning RTS23#35 = „AGRI“ ja RTS2#5 = „OPTN“</p> | <p>Põllumajandusliku kauba optiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#36 ja RTS23#37) – alusvaraks olev põllumajanduslik kaup (alamtoode ja muu alamtoode)</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#15) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles optiooni tinglik väärtus on nomineeritud</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#8) – optiooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 2: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> | 10 000 000 eurot | 10 |

| Varaklass – kauba tuletisinstrumentid | | | |
|---|---|--|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mittemoavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| | <p>Tähtajaklass 4: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat</p> | | |
| <p>Põllumajandusliku kauba vahetustehingud</p> <p>RTS2#3 = „DERV“ ja RTS2#4 = „COMM“ ning RTS23#35 = „AGRI“ ja RTS2#5 = „SWAP“</p> | <p>Põllumajandusliku kauba vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#36 ja RTS23#37) – alusvaraks olev põllumajanduslik kaup (alamtoode ja muu alamtoode)</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#15) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles vahetustehingu tinglik väärtus on nomineeritud</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS23#34) – tarne liik, mis on määratletud sularahas, füüsilise või valikulisena</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 4 (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: 0 < järelejäänud tähtaeg ≤ 3 kuud</p> <p>Tähtajaklass 2: 3 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 6 kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: 6 kuud < järelejäänud tähtaeg ≤ 1 aasta</p> <p>Tähtajaklass 4: 1 aasta < järelejäänud tähtaeg ≤ 2 aastat</p> | 10 000 000 eurot | 10 |

| Varaklass – kauba tuletisinstrumentid | | | |
|---|--|--|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest künnistest | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| | ... Tähtajaklass m: $(n - 1)$ aastat $<$ järelejäänud tähtaeg $\leq n$ aastat | | |
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat | | |
| Muud kauba tuletisinstrumentid Kauba tuletisinstrument, mis ei kuulu ühessegi ülalnimetatud varade alamklassi | Mis tahes muud kauba tuletisinstrumenti käsitatakse likviidset turgu mitteomavana“. | | |

9) Tabel 8.1 asendatakse järgmisega:

„Tabel 8.1

Välisvaluuta tuletisinstrumentid – klassid, millel ei ole likviidset turgu

| Varaklass – välisvaluuta tuletisinstrumentid | | | |
|--|---|---|---|
| Finantsinstrument, mis on seotud valuutadega, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktis 4 | | | |
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| <p>Mitteülekantav forward</p> <p>Forward, mis kuulub lepingu tingimuste kohaselt selle poolte vahel rahas arveldamisele ja mille arveldussumma määratakse kindlaks kahe valuuta kauplemis- ja hindamispäeva vahetuskursi erinevuse põhjal. Arvelduspäeval võlgneb üks pool teisele netoerinevuse i) kauplemispäeval kehtiva vahetuskursi ning ii) hindamispäeva vahetuskursi vahel, lähtudes tinglikust väärtusest ja arvestades, et see netosumma kuulub tasumisele lepingus sätestatud arveldusvaluutas.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = FORW</p> <p>RTS2#26 = NDLV</p> | <p>Mitteülekantava välisvaluutaforvardi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#13 ja RTS23#47) – aluseks olevate valuutade paar, mis on määratletud kui kahe tuletislepingu aluseks oleva valuuta kombinatsioon</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – forvardi järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ nädal</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ nädal} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 4: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 5: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | <p>Mitteülekantavaid forvardeid käsitatakse likviidset turgu mitteomavana</p> | |

| Varaklass – välisvaluuta tuletisinstrumendid | | | |
|---|--|---|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| <p>Ülekantav forvard</p> <p>Forvard, mis hõlmab üksnes kahe eri valuuta vahetust teataval tulevasel lepingus kokku lepitud arvelduspäeval ja fikseeritud määraga, mis on kokku lepitud valuutavahetust käsitleva lepingu sõlmimisel.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR'</p> <p>RTS2#5 = FORW</p> <p>RTS2#26 = DLVB</p> | <p>Ülekantava välisvaluutaforvardi alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#13 ja RTS23#47) – aluseks olevate valuutade paar, mis on määratletud kui kahe tuletislepingu aluseks oleva valuuta kombinatsioon</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – forvardi järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ nädal</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ nädal} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 4: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 5: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | <p>Ülekantavaid forvardeid käsitatakse likviidset turgu mitteomavana</p> | |

| Varaklass – välisvaluuta tuletisinstrumendid | | | |
|--|---|---|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| <p>Mitteülekantavad välisvaluutaoptsioonid</p> <p>Opsioon, mis kuulub lepingu tingimuste kohaselt selle poolte vahel rahas arveldamisele ja mille arveldussumma määratakse kindlaks kahe valuuta kauplemis- ja hindamispäeva vahetuskursi erinevuse põhjal. Arvelduspäeval võlgneb üks pool teisele netoerinevuse i) kauplemispäeval kehtiva vahetuskursi ning ii) hindamispäeva vahetuskursi vahel, lähtudes tinglikust väärtusest ja arvestades, et see netosumma kuulub tasumisele lepingus sätestatud arveldusvaluutas.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR'</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#26 = NDLV</p> | <p>Mitteülekantava välisvaluutaopsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#13 ja RTS23#47) – aluseks olevate valuutade paar, mis on määratletud kui kahe tuletislepingu aluseks oleva valuuta kombinatsioon</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – opsiooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ nädal</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ nädal} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 4: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 5: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | <p>Mitteülekantavaid välisvaluutaoptioone käsitatakse likviidset turgu mitteomavana</p> | |

| Varaklass – välisvaluuta tuletisinstrumendid | | | |
|---|--|---|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| <p>Ülekantavad välisvaluutaoptsioonid</p> <p>Opsioon, mis hõlmab üksnes kahe eri valuuta vahetust teataval tulevasel lepingus kokku lepitud arvelduspäeval ja fikseeritud määraga, mis on kokku lepitud valuutavahetust käsitleva lepingu sõlmimisel.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#26 = DLVB</p> | <p>Ülekantava välisvaluutaoptsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#13 ja RTS23#47) – aluseks olevate valuutade paar, mis on määratletud kui kahe tuletislepingu aluseks oleva valuuta kombinatsioon</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – optsiooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ nädal</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ nädal} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 4: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 5: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | <p>Ülekantavaid välisvaluutaoptsioone käsitatakse likviidset turgu mitteomavana</p> | |

| Varaklass – välisvaluuta tuletisinstrumendid | | | |
|--|--|---|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| <p>Mitteülekantavad välisvaluuta vahetustehingud</p> <p>Vahetustehing, mis kuulub lepingu tingimuste kohaselt selle poolte vahel rahas arveldamisele ja mille arveldussumma määratakse kindlaks kahe valuuta kauplemis- ja hindamispäeva vahetuskursi erinevuse põhjal. Arvelduspäeval võlgneb üks pool teisele netoerinevuse i) kauplemispäeval kehtiva vahetuskursi ning ii) hindamispäeva vahetuskursi vahel, lähtudes tinglikust väärtusest ja arvestades, et see netosumma kuulub tasumisele lepingus sätestatud arveldusvaluutas.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR'</p> <p>RTS2#5 = SWAP</p> <p>RTS2#26 = NDLV</p> | <p>Mitteülekantava välisvaluuta vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#13 ja RTS23#47) – aluseks olevate valuutade paar, mis on määratletud kui kahe tuletislepingu aluseks oleva valuuta kombinatsioon</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäanud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäanud tähtaeg} \leq 1$ nädal</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ nädal} < \text{järelejäanud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäanud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 4: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäanud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 5: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäanud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäanud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | <p>Mitteülekantavaid välisvaluuta vahetustehinguid käsitatakse likviidset turgu mitteomavana</p> | |

| Varaklass – välisvaluuta tuletisinstrumendid | | | |
|---|---|---|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| <p>Ülekantavad välisvaluuta vahetustehingud</p> <p>Vahetustehing, mis hõlmab üksnes kahe eri valuuta vahetust teataval tulevasel lepingus kokku lepitud arvelduspäeval ja fikseeritud määraga, mis on kokku lepitud valuutavahetust käsitleva lepingu sõlmimisel.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = SWAP</p> <p>RTS2#26 = DLVB</p> | <p>Ülekantava välisvaluuta vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#13 ja RTS23#47) – aluseks olevate valuutade paar, mis on määratletud kui kahe tuletislepingu aluseks oleva valuuta kombinatsioon</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ nädal</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ nädal} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 4: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 5: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | <p>Ülekantavaid välisvaluuta vahetustehinguid käsitatakse likviidset turgu mitteomavana</p> | |

| Varaklass – välisvaluuta tuletisinstrumendid | | | |
|--|--|---|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| Välisvaluutafutuudid RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR' RTS2#5 = FUTR | Välisvaluutafutuuri alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#13 ja RTS23#47) – aluseks olevate valuutade paar, mis on määratletud kui kahe tuletislepingu aluseks oleva valuuta kombinatsioon Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – futuuri järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt: Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ nädal Tähtajaklass 2: $1 \text{ nädal} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ kuud Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta Tähtajaklass 4: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat Tähtajaklass 5: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat ... Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat | Välisvaluutafutuure käsitatakse likviidset turgu mitteomavana | |
| Varaklass – välisvaluuta tuletisinstrumendid | | | |
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist meetodikat | | |
| Muud välisvaluuta tuletisinstrumendid Välisvaluuta tuletisinstrument, mis ei kuulu ühessegi ülalnimetatud varade alamklassi RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = OTHR | Mis tahes muud välisvaluuta tuletisinstrumenti käsitatakse likviidset turgu mitteomavana“. | | |

10) Tabelid 9.1, 9.2 ja 9.3 asendatakse järgmistega:

„Tabel 9.1

Krediituletisinstrumentid – klassid, millel ei ole likviidset turgu

| Varaklass – krediituletisinstrumentid | | | | |
|---|---|---|---|--|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Indeksi staatus <i>on-the-run</i> [täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium] |
| <p>Indeksipõhine krediidiriski vahetustehing – vahetustehing, mille rahavoogude vahetamine on seotud indeksisse kuuluvate finantsinstrumentide mitme emitendi krediidivõimelisusega ja krediisündmuste toimumisega</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT</p> | <p>Indeksipõhise krediidiriski vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS2#34) – aluseks olev indeks</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#42) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles tuletisinstrumenti tinglik väärtus on nomineeritud</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#8) – krediidiriski vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 3: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> <p>...</p> <p>Tähtajaklass m: $(n - 1) \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq n$ aastat</p> | 200 000 000 eurot | 10 | <p>Aluseks olevat indeksit käsitatakse likviidset turgu omavana:</p> <ol style="list-style-type: none"> kogu sellisel perioodil, mil staatus on „<i>on-the-run</i>“; sellise perioodi esimese 30 tööpäeva jooksul, mil staatus on „<i>1x off-the-run</i>“. <p><i>On-the-run</i>-indeks tähendab jooksvat kõige viimast versiooni (seeriat) indeksist, mis on loodud sel kuupäeval, millal indeksi koostis kehtima hakkab, ja lõpeb üks päev enne kuupäeva, millal indeksi järgmise versiooni (seeria) koostis kehtima hakkab.</p> <p>Staatus <i>1x off-the-run</i> tähendab indeksi seda versiooni (seeriat), mis eelneb vahetult kehtivale <i>on-the-run</i>-versioonile (seeriale) teataval ajahetkel. Versioon (seeria) ei ole enam <i>on-the-run</i> ja saab staatuse <i>1x off-the-run</i>, kui luuakse indeksi värskeim versioon (seeria).</p> |

| Varaklass – krediidituleisinstrumentid | | | | |
|---|--|---|---|--|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Indeksi staatus <i>on-the-run</i> [täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium] |
| <p>Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehing – vahetustehing, mille rahavoogude vahetamine on seotud finantsinstrumentide ühe emitendi krediidivõimelisusega ja krediidisündmuste toimumisega</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT</p> | <p>Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS2#41) – aluseks olev võrdlusüksus</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#39) – aluseks oleva võrdlusüksuse liik, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>„Riigi ja avaliku sektori tüüpi emitent“ on emiteeriv üksus, mis on kas:</p> <ol style="list-style-type: none"> liit; liikmesriik, k.a liikmesriigi valitsusasutus, amet või eriotstarbeline üksus; riigi üksus, mis ei ole loetletud punktides a ja b; liitriigist liikmesriigi puhul liitriigi liige; mitme liikmesriigi eriotstarbeline üksus; | 10 000 000 eurot | 10 | |

| Varaklass – krediidituletisinstrumendid | | | | |
|---|--|---|---|--|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Indeksi staatus <i>on-the-run</i> [täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium] |
| | <p>f. rahvusvaheline finantsasutus, mille on asutanud vähemalt kaks liikmesriiki ja mille eesmärk on koondada rahalisi vahendeid ning anda rahalist abi oma liikmetele, kellel on või keda ohustavad ulatuslikud finantsprobleemid;</p> <p>g. Euroopa Investeeringuspank;</p> <p>h. avaliku sektori asutus, mis ei ole avaliku sektori emitent, nagu on täpsustatud punktides a–c.</p> <p>„Äriühingu tüüpi emitent“ on emiteeriv üksus, mis ei ole riigi ega avaliku sektori tüüpi emitent.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#42) – tinglik valuuta, mis on määratletud kui valuuta, milles tuletisinstrumendi tinglik väärtus on nomineeritud</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 4 (RTS2#8) – krediidi-riski vahetustehingu järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 3: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> | | | |

| Varaklass – krediituletisinstrumentid | | | | |
|---|---|--|---|--|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Indeksi staatus <i>on-the-run</i> [täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium] |
| | ... | | | |
| | Tähtjaklass m: $(n - 1)$ aastat < järelejäänud tähtaeg $\leq n$ aastat | | | |
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta järgmisele kvalitatiivsele likviidsuse kriteeriumile | | |
| Krediidiriski vahetustehingu indeksi optioonid – optioon, mille aluseks on krediidiriski vahetustehingu indeks RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CRDT | <p>Krediidiriski vahetustehingu indeksi optiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#26) – krediidiriski vahetustehingu indeksi alamklass, nagu on määratletud indeksipõhise krediidiriski vahetustehingu vara alamklassi puhul</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – optiooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtjaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud</p> <p>Tähtjaklass 2: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtjaklass 3: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtjaklass 4: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> | <p>Krediidiriski vahetustehingu indeksi optiooni, mille aluseks olev krediidiriski vahetustehingu indeks on alamklass, mille puhul on määratud kindlaks, et sellel on likviidne turg, ja mille järelejäänud tähtaja klass on 0–6 kuud, käsitatakse likviidset turgu omavana</p> <p>Krediidiriski vahetustehingu indeksi optiooni, mille aluseks olev krediidiriski vahetustehingu indeks on alamklass, mille puhul on määratud kindlaks, et sellel on likviidne turg, ja mille järelejäänud tähtaja klass ei ole 0–6 kuud, käsitatakse likviidset turgu mitteomavana</p> <p>Krediidiriski vahetustehingu indeksi optiooni, mille aluseks olev krediidiriski vahetustehingu indeks on alamklass, mille puhul on määratud kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu, käsitatakse mis tahes järelejäänud tähtaja klassi puhul likviidset turgu mitteomavana</p> | | |

| Varaklass – krediituletisinstrumentid | | | | |
|---|--|--|---|--|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Indeksi staatus <i>on-the-run</i> [täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium] |
| | ... | | | |
| | <p>Tähtajaklass m: $(n - 1)$ aastat < järelejäänud tähtaeg $\leq n$ aastat</p> | | | |
| <p>Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu optsioonid – optsioon, mille alusvara on ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehing</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT</p> | <p>Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu optsiooni alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi.</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS23#26) – ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu alamklass, nagu on määratletud ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu vara alamklassi puhul</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS2#8) – optsiooni järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6$ kuud</p> <p>Tähtajaklass 2: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1$ aasta</p> <p>Tähtajaklass 3: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2$ aastat</p> <p>Tähtajaklass 4: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3$ aastat</p> | <p>Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu optsiooni, mille alusvaraks olev ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehing on alamklass, mille puhul on määratud kindlaks, et sellel on likviidne turg, ning mille järelejäänud tähtaja klass on 0–6 kuud, käsitatakse likviidset turgu omavana</p> <p>Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu optsiooni, mille alusvaraks olev ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehing on alamklass, mille puhul on määratud kindlaks, et sellel on likviidne turg, ning mille järelejäänud tähtaja klass ei ole 0–6 kuud, käsitatakse likviidset turgu mitteomavana</p> <p>Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu optsiooni, mille alusvaraks olev ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehing on alamklass, mille puhul on määratud kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu, käsitatakse mis tahes järelejäänud tähtaja klassi puhul likviidset turgu mitteomavana</p> | | |

| Varaklass – krediituletisinstrumentid | | | | |
|--|--|---|---|--|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest. Alamklasside suhtes, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg, kohaldatakse asjakohasel juhul täiendavat kvalitatiivset likviidsuse kriteeriumi | | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] | Indeksi staatus <i>on-the-run</i> [täiendav kvalitatiivne likviidsuse kriteerium] |
| | ... Tähtajaklass m: (n – 1) aastat < järelejäänud tähtaeg ≤ n aastat | | | |
| Varaklass – krediituletisinstrumentid | | | | |
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat | | | |
| Muud krediituletisinstrumentid – krediituletisinstrument, mis ei kuulu ühessegi ülalnimetatud varade alamklassi RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CRDT RTS2#5 = OTHR | Mis tahes muud krediituletisinstrumenti käsitatakse likviidset turgu mitteomavana | | | |

Tabel 9.2

Krediituletisinstrumentid – kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg

| Varaklass – krediituletisinstrumentid | | | | | | | | | | | | | | |
|--|---|--|----|----|----|---------------------------|------------------------|---|------------------------|--------------------|----------------------------|------------------------|--------------------|-----------------------|
| Varade alamklass | Kauplemiseelsete ja -järgsete künniste arvutamisel kohaldatavad protsentiilid ja alumised künnisväärtused instrumendile omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil on likviidne turg | Instrumendile omane maht, kauplemiseelne | | | | Suur maht, kauplemiseelne | | Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne | | | Suur maht, kauplemisjärgne | | | |
| | | Tehingud, mida võetakse künniste arvutamisel arvesse | | | | Alumine künnisväärtus | Tehingud – protsentiil | Alumine künnisväärtus | Tehingud – protsentiil | Maht – protsentiil | Alumine künnisväärtus | Tehingud – protsentiil | Maht – protsentiil | Alumine künnisväärtus |
| | | Tehingud – protsentiil | | | | | | | | | | | | |
| Indeksipõhine krediidiriski vahetustehing | Künnised arvutatakse iga varade alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid | S1 | S2 | S3 | S4 | 2 500 000 eurot | 70 | 5 000 000 eurot | 80 | 60 | 7 500 000 eurot | 90 | 70 | 10 000 000 eurot |
| | | 30 | 40 | 50 | 60 | | | | | | | | | |
| Ühe alusvraga krediidiriski vahetustehing | Künnised arvutatakse iga varade alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumentidega tehtud tehinguid | S1 | S2 | S3 | S4 | 2 500 000 eurot | 70 | 5 000 000 eurot | 80 | 60 | 7 500 000 eurot | 90 | 70 | 10 000 000 eurot |
| | | 30 | 40 | 50 | 60 | | | | | | | | | |

Varaklass – krediituletisinstrumendid

| Varade alamklass | Tehingud, mida võetakse kün­niste arvutamisel arvesse | Instrumendile omane maht, kauplemiseelne | | | | Suur maht, kauplemiseelne | | Instrumendile omane maht, kauplemisjärgne | | | Suur maht, kauplemisjärgne | | | |
|---|---|--|----|----|----|---------------------------|------------------------|---|------------------------|--------------------|----------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------|
| | | Tehingud – protsentiil | | | | Alumine kün­nis­väärtus | Tehingud – protsentiil | Alumine kün­nis­väärtus | Tehingud – protsentiil | Maht – protsentiil | Alumine kün­nis­väärtus | Tehingud – protsentiil | Maht – protsentiil | Alumine kün­nis­väärtus |
| | | S1 | S2 | S3 | S4 | | | | | | | | | |
| Krediidiriski vahetuste-hingu indeksi optioonid | Künnised arvutatakse iga varade alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumendidega tehtud tehinguid | S1 | S2 | S3 | S4 | 2 500 000 eurot | 70 | 5 000 000 eurot | 80 | 60 | 7 500 000 eurot | 90 | 70 | 10 000 000 eurot |
| | | 30 | 40 | 50 | 60 | | | | | | | | | |
| Ühe alusvарага krediidiriski vahetus-tehingu optioonid | Künnised arvutatakse iga varade alamklassi kohta, arvestades alamklassi kuuluvate finantsinstrumendidega tehtud tehinguid | S1 | S2 | S3 | S4 | 2 500 000 eurot | 70 | 5 000 000 eurot | 80 | 60 | 7 500 000 eurot | 90 | 70 | 10 000 000 eurot |
| | | 30 | 40 | 50 | 60 | | | | | | | | | |

Tabel 9.3

Krediituletisinstrumentid – kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumentide omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu

| Varaklass – krediituletisinstrumentid | | | | |
|---|--|---------------------------|---|----------------------------|
| Varade alamklass | Kauplemiseelsed ja -järgsed künnised instrumentide omase mahu ning suure mahu puhul alamklasside korral, mille puhul on määratud kindlaks, et neil ei ole likviidset turgu | | | |
| | Instrumentide omane maht, kauplemiseelne | Suur maht, kauplemiseelne | Instrumentide omane maht, kauplemisjärgne | Suur maht, kauplemisjärgne |
| | Künnisväärtus | Künnisväärtus | Künnisväärtus | Künnisväärtus |
| Indeksipõhine krediidiriski vahetustehing | 2 500 000 eurot | 5 000 000 eurot | 7 500 000 eurot | 10 000 000 eurot |
| Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehing | 2 500 000 eurot | 5 000 000 eurot | 7 500 000 eurot | 10 000 000 eurot |
| Krediidiriski vahetustehingu indeksi optioonid | 2 500 000 eurot | 5 000 000 eurot | 7 500 000 eurot | 10 000 000 eurot |
| Ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu optioonid | 2 500 000 eurot | 5 000 000 eurot | 7 500 000 eurot | 10 000 000 eurot |
| Muud krediituletisinstrumentid | 2 500 000 eurot | 5 000 000 eurot | 7 500 000 eurot | 10 000 000 eurot“. |

11) Tabel 10.1 asendatakse järgmisega:

„Tabel 10.1

C10 tuletisinstrumentid – klassid, millel ei ole likviidset turgu

| Varaklass – C10 tuletisinstrumentid | | | |
|--|---|---|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| Veose tuletisinstrumentid Finantsinstrument, mis on seotud prahihahaga, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktis 10 RTS2#3 = „DERV“ ja RTS2#4 = „COMM“ ning RTS23#35 = „FRGT“ | Veose tuletisinstrumenti alamklass määratakse kindlaks järgmiste segmenteerimiskriteeriumide järgi. Segmenteerimiskriteerium 1 (RTS2#5) – lepingu liik: futuurid või optioonid Segmenteerimiskriteerium 2 (RTS23#36) – veose liik | 10 000 000 eurot | 10 |

| Varaklass – C10 tuletisinstrumendid | | | |
|-------------------------------------|---|---|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| | <p>Segmenteerimiskriteerium 3 (RTS2#37) – veose alaliik</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 4 (RTS2#12) – veose alaliigiga seotud mahu määratlus</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 5 (RTS2#13) – kindel marsruut või tähtajalise prahtimise keskmine</p> <p>Segmenteerimiskriteerium 6 (RTS2#8) – tuletisinstrumenti järelejäänud tähtaja klass, mis on määratletud järgmiselt:</p> <p>Tähtajaklass 1: $0 < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1 \text{ kuu}$</p> <p>Tähtajaklass 2: $1 \text{ kuu} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3 \text{ kuud}$</p> <p>Tähtajaklass 3: $3 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 6 \text{ kuud}$</p> <p>Tähtajaklass 4: $6 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 9 \text{ kuud}$</p> <p>Tähtajaklass 5: $9 \text{ kuud} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 1 \text{ aasta}$</p> <p>Tähtajaklass 6: $1 \text{ aasta} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 2 \text{ aastat}$</p> <p>Tähtajaklass 7: $2 \text{ aastat} < \text{järelejäänud tähtaeg} \leq 3 \text{ aastat}$</p> | | |

| Varaklass – C10 tuletisinstrumendid | | | |
|---|--|---|---|
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest | |
| | | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| | ... | | |
| | Tähtajaklass m: $(n - 1)$ aastat < järelejäänud tähtaeg $\leq n$ aastat | | |
| Varaklass – C10 tuletisinstrumendid | | | |
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat | | |
| Muud C10 tuletisinstrumendid | Mis tahes muid C10 tuletisinstrumente käsitatakse likviidset turgu mitteomavana“. | | |
| Direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktis 10 määratletud finantsinstrument, mis ei ole veose tuletisinstrument; mis tahes järgmine intressimäära tuletisinstrumendi alamklassidest: mitmes valuutas või erinevates valuutades inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehing, mitmes valuutas või erinevates valuutades inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forvardid, ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehing, ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forvardid; mis tahes järgmine aktsiatel põhinevate tuletisinstrumentide alamklassidest: volatiilsusindeksifutuur/-forvard, tulususe variatsiooni parameetriga (<i>parameter return variance</i>) vahetustehing, volatiilsuse tulususe parameetriga (<i>parameter return volatility</i>) vahetustehing, tulususe variatsiooni parameetriga (<i>parameter return variance</i>) portfelli vahetustehing, tulususe volatiilsuse parameetriga (<i>parameter return volatility</i>) portfelli vahetustehing | | | |

12) Tabel 11.1 asendatakse järgmisega:

„Tabel 11.1

Hinnavahelepingud – klassid, millel ei ole likviidset turgu

| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Kvalitatiivne likviidsuse kriteerium | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
|--|--|---|---|---|
| Valuuta hinnavahelepingud RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = CURR | Valuuta hinnavahelepingute alamklass määratakse kindlaks aluseks olevate valuutade paari põhjal, mis on määratletud kui hinnavahelepingu / hinnavahekihlveo lepingu aluseks oleva kahe valuuta kombinatsioon RTS2#30 ja RTS2#31 | | 50 000 000 eurot | 100 |
| Kauba hinnavahelepingud RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = COMM | Kauba hinnavahelepingute alamklass määratakse kindlaks hinnavahelepingu / hinnavahekihlveo lepingu alusvaraks oleva kauba põhjal RTS23#35 ja RTS23#36 ning RTS23#37 | | 50 000 000 eurot | 100 |
| Kapitali hinnavahelepingud RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = EQUI | Kapitali hinnavahelepingute alamklass määratakse kindlaks hinnavahelepingu / hinnavahekihlveo lepingu alusvaraks oleva kapitaliväärtpaberi põhjal RTS23#26 | Kapitali hinnavahelepingu alamklassi käsitatakse likviidset turgu omavana, kui alusvara on kapitaliväärtpaber, millel on likviidne turg, nagu on kindlaks määratud kooskõlas määruse (EL) nr 600/2014 artikli 2 lõike 1 punkti 17 alapunktiga b | | |
| Võlakirjade hinnavahelepingud RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = BOND | Võlakirja hinnavahelepingute alamklass määratakse kindlaks hinnavahelepingu / hinnavahekihlveo lepingu alusvaraks oleva võlakirja või võlakirjafutuuri põhjal RTS23#26 | Võlakirja hinnavahelepingu alamklassi käsitatakse likviidset turgu omavana, kui alusvara on võlakiri või võlakirjafutuur, millel on likviidne turg, nagu on kindlaks määratud kooskõlas artikliga 6 ja artikli 8 lõike 1 punktiga b. | | |

| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, segmenteeritakse iga varade alamklass täiendavalt alamklassidesse, nagu on määratletud allpool | Kvalitatiivne likviidsuse kriteerium | Keskmine päevane tinglik väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
|---|--|--|--|--|
| Aktsiafutuuri/-forvardi hinnavahelepingud RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = FTEQ | Aktsiafutuuri/-forvardi hinnavahelepingu alamklass määratakse kindlaks hinnavahelepingu / hinnavahekihlveo lepingu alusvaraks oleva aktsiafutuuri/-forvardi põhjal RTS23#26 | Aktsiafutuuri/-forvardi hinnavahelepingu alamklassi käsitatakse likviidset turgu omavana, kui alusvara on aktsiafutuuri/-forvard, millel on likviidne turg, nagu on kindlaks määratud kooskõlas artikliga 6 ja artikli 8 lõike 1 punktiga b. | | |
| Aktsiaoptiooni hinnavahelepingud RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OPEQ | Aktsiaoptiooni hinnavahelepingu alamklass määratakse kindlaks hinnavahelepingu / hinnavahekihlveo lepingu alusvaraks oleva aktsiaoptiooni põhjal RTS23#26 | Aktsiaoptiooni hinnavahelepingu alamklassi käsitatakse likviidset turgu omavana, kui alusvara on aktsiaoptioon, millel on likviidne turg, nagu on kindlaks määratud kooskõlas artikliga 6 ja artikli 8 lõike 1 punktiga b. | | |
| Varaklass – hinnavahelepingud | | | | |
| Varade alamklass | Selliste finantsinstrumentide klasside kindlaksmääramiseks, mida käsitatakse likviidset turgu mitteomavana artikli 6 ja artikli 8 lõike 1 punkti b järgi, kasutatakse järgmist metoodikat | | | |
| Muud hinnavahelepingud | | | | |
| Hinnavaheleping / hinnavahekihlveo leping, mis ei kuulu ühessegi ülalnimeetatud varade alamklassi RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OTHR | Mis tahes muid hinnavahelepinguid / hinnavahekihlveo lepinguid käsitatakse likviidset turgu mitteomavana“. | | | |

13) Tabel 12.1 asendatakse järgmisega:

„Tabel 12.1

Lubatud heitkoguste väärtpaberid – klassid, millel ei ole likviidset turgu

| Varaklass – lubatud heitkoguste väärtpaberid | | |
|--|---|---|
| Varade alamklass | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest | |
| | Keskmine päevane väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| <p>Lubatud heitkoguse ühikud (LHÜd)</p> <p>Mis tahes ühik, mis on tunnistanud vastavaks Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2003/87/EÜ ⁽¹⁾ nõuetele (heitkogustega kauplemise süsteem) ja mis vastab õigusele tekitada heitkogus, mis on samaväärne ühe CO₂ ekvivalenttonniga</p> <p>RTS2#3 = EMAL ja RTS2#11 = EUAE</p> | 150 000 CO ₂ ekvivalenttonni | 5 |
| <p>Lennunduse lubatud heitkoguse ühikud (lennunduse LHÜd)</p> <p>Mis tahes ühik, mis on tunnistanud vastavaks direktiivi 2003/87/EÜ nõuetele (heitkogustega kauplemise süsteem) ja mis vastab õigusele tekitada heitkogus, mis on samaväärne ühe lennunduse CO₂ ekvivalenttonniga</p> <p>RTS2#3 = EMAL ja RTS2#11 = EUAA</p> | 150 000 CO ₂ ekvivalenttonni | 5 |
| <p>Tõendatud heitkoguste vähendamise ühikud (THVd)</p> <p>Mis tahes ühik, mis on tunnistanud vastavaks direktiivi 2003/87/EÜ nõuetele (heitkogustega kauplemise süsteem) ja mis vastab heitkoguse vähendamisele ulatuses, mis on samaväärne ühe CO₂ ekvivalenttonniga</p> <p>RTS2#3 = EMAL ja RTS2#11 = CERE</p> | 150 000 CO ₂ ekvivalenttonni | 5 |

| Varaklass – lubatud heitkoguste väärtpaberid | | |
|---|---|---|
| Varade alamklass | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest | |
| | Keskmine päevane väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| Heitkoguste vähendamise ühikud (HVÜd) Mis tahes ühik, mis on tunnistanud vastavaks direktiivi 2003/87/EÜ nõuetele (heitkogustega kauplemise süsteem) ja mis vastab heitkoguse vähendamisele ulatuses, mis on samaväärne ühe CO ₂ ekvivalenttonniga RTS2#3 = EMAL ja RTS2#11 = ERUE | 150 000 CO2 ekvivalenttonni | 5 |
| Muud lubatud heitkoguste väärtpaberid Lubatud heitkoguste väärtpaber, mis on tunnistanud vastavaks direktiivi 2003/87/EÜ nõuetele (heitkogustega kauplemise süsteem) ning mis ei ole lubatud heitkoguse ühik (LHÜ), lennunduse lubatud heitkoguse ühik (lennunduse LHÜ), tõendatud heitkoguste vähendamise ühik (THV) või heitkoguste vähendamise ühik (HVÜ) RTS2#3 = EMAL ja RTS2#11 = OTHR | Mis tahes muid lubatud heitkoguste väärtpabereid käsitatakse likviidset turgu mitteomavana | |
| (1) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 13. oktoobri 2003. aasta direktiiv 2003/87/EÜ, millega luuakse ühenduses kasvuhoonegaaside saastekvootidega kauplemise süsteem ja muudetakse nõukogu direktiivi 96/61/EÜ (ELT L 275, 25.10.2003, lk 32).“ | | |

14) Tabel 13.1 asendatakse järgmisega:

„Tabel 13.1

Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentid – klassid, millel ei ole likviidset turgu

| Varade alamklass | Varaklass – lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentid | |
|--|---|---|
| | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest | |
| | Keskmine päevane väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| <p>Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentid, mille alusvara on lubatud heitkoguse ühiku (LHÜ) tüüpi</p> <p>Finantsinstrument, mis on seotud lubatud heitkoguse ühiku (LHÜ) tüüpi lubatud heitkoguste väärtpaberitega, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktis 4</p> <p>RTS2#3 = DERV ja RTS2#4 = EMAL ning RTS2#43 = EUAE</p> | 150 000 CO2 ekvivalenttonni | 5 |
| <p>Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentid, mille alusvara on lennunduse lubatud heitkoguse ühiku (lennunduse LHÜ) tüüpi</p> <p>Finantsinstrument, mis on seotud lennunduse lubatud heitkoguse ühiku (lennunduse LHÜ) tüüpi lubatud heitkoguste väärtpaberitega, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktis 4</p> <p>RTS2#3 = DERV ja RTS2#4 = EMAL ning RTS2#43 = EUAA</p> | 150 000 CO2 ekvivalenttonni | 5 |
| <p>Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentid, mille alusvara on tõendatud heitkoguste vähendamise ühiku (THV) tüüpi</p> <p>Finantsinstrument, mis on seotud tõendatud heitkoguste vähendamise ühiku (THV) tüüpi lubatud heitkoguste väärtpaberitega, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktis 4</p> <p>RTS2#3 = DERV ja RTS2#4 = EMAL ning RTS2#43 = CERE</p> | 150 000 CO2 ekvivalenttonni | 5 |

| Varaklass – lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentid | | |
|--|---|---|
| Varade alamklass | Iga alamklassi puhul määratakse kindlaks, et sellel ei ole likviidset turgu vastavalt artiklile 6 ja artikli 8 lõike 1 punktile b, kui see ei vasta ühele või kõikidele järgmistest kvantitatiivsete likviidsuse kriteeriumide künnistest | |
| | Keskmine päevane väärtus [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 1] | Keskmine päevane tehingute arv [kvantitatiivne likviidsuse kriteerium 2] |
| <p>Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentid, mille alusvara on heitkoguste vähendamise ühiku (HVÜ) tüüpi</p> <p>Finantsinstrument, mis on seotud heitkoguste vähendamise ühiku (HVÜ) tüüpi lubatud heitkoguste väärtpaberitega, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktis 4</p> <p>RTS2#3 = DERV ja RTS2#4 = EMAL ning RTS2#43 = ERUE</p> | 150 000 CO2 ekvivalenttonni | 5 |
| <p>Muud lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentid</p> <p>Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrument, mille alusvara on tunnistatud vastavaks direktiivi 2003/87/EÜ nõuetele (heitkogustega kauplemise süsteem) ning mis ei ole lubatud heitkoguse ühik (LHÜ), lennunduse lubatud heitkoguse ühik (lennunduse LHÜ), tõendatud heitkoguste vähendamise ühik (THV) ega heitkoguste vähendamise ühik (HVÜ)</p> <p>RTS2#3 = DERV ja RTS2#4 = EMAL ning RTS2#43 = OTHR</p> | Mis tahes muid lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumente käsitatakse likviidset turgu mitteomavana“. | |

IV LISA

IV lisas asendatakse tabelid 1 ja 2 järgmistega:

„Tabel 1

Tabelis 2 kasutatavad tähised

| TÄHIS | ANDMETE LIIK | MÄÄRATLUS |
|------------------|--|--|
| {ALPHANUM-n} | Kuni n tähtnumbrilist märki | Vabateksti lahter |
| {DECIMAL-n/m} | Kuni n-kohaline kümnendarv, milles võib olla m kohta pärast koma | Lahtrise kantakse kas positiivne või negatiivne arv: — kümnendkohtade eraldusmärk on punkt (.); — arvu ees võib olla miinusmärk (-), mis tähistab negatiivset väärtust. Vajaduse korral väärtused ümardatakse, neid ei kärbita. |
| {COUNTRYCODE_2} | 2 tähtnumbrilist märki | Kahetäheline riigikood (ISO 3166-1 alpha-2 riigikood) |
| {CURRENCYCODE_3} | 3 tähtnumbrilist märki | Kolmetäheline valuutakood (ISO 4217 valuutakood) |
| {DATEFORMAT} | ISO 8601 kuupäevavorming | Kuupäevad tuleb esitada järgmisel kujul: AAAA-KK-PP |
| {ISIN} | 12 tähtnumbrilist märki | ISIN kood, nagu on määratletud standardis ISO 6166 |
| {LEI} | 20 tähtnumbrilist märki | Juriidilise isiku tunnus, nagu on määratletud standardis ISO 17442 |
| {MIC} | 4 tähtnumbrilist märki | Turu tunnuscode, nagu on määratletud standardis ISO 10383 |
| {EIC} | 16 tähtnumbrilist märki | Euroopa Liidus või väljaspool seda asuva tarnekohta EIC-kood |
| {INDEX} | 4 tähtnumbrilist märki | „EONA“ – EONIA „EONS“ – EONIA SWAP „EURI“ – EURIBOR „EUUS“ – EURODOLLAR „EUCH“ – EuroSwiss „GCFR“ – GCF REPO „ISDA“ – ISDAFIX „LIBI“ – LIBID „LIBO“ – LIBOR |

| TÄHIS | ANDMETE LIIK | MÄÄRATLUS |
|-------|--------------|--|
| | | „MAAA“ – Muni AAA „PFAN“ – Pfandbriefe „TIBO“ – TIBOR „STBO“ – STIBOR „BBSW“ – BBSW „JIBA“ – JIBAR „BUBO“ – BUBOR „CDOR“ – CDOR „CIBO“ – CIBOR |

Tabel 2

Läbipaistvusarvutuste jaoks esitatavate võrdlusandmete üksikasjad

| Nr | LAHTER | ESITATAVAD ANDMED | ARUANDE VORMING |
|----|--------------------------------|--|---|
| 1 | Finantsinstrumendi tunnuskoode | Finantsinstrumendi tuvastamiseks kasutatav kood | {ISIN} |
| 2 | Finantsinstrumendi täisnimi | Finantsinstrumendi täielik nimi | {ALPHANUM-350} |
| 3 | MiFIRi kohane tunnus | <p>Mittekapitaliinstrumentide identifitseerimine</p> <p>Väärtpaberistatud tuletisinstrumentid, nagu on määratletud III lisa 4. jao tabelis 4.1</p> <p>Struktureeritud finantstooted, nagu on määratletud määruse (EL) nr 600/2014 artikli 2 lõike 1 punktis 28</p> <p>Võlakirjad (kõik võlakirjad, välja arvatud börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad), nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL artikli 4 lõike 1 punkti 44 alapunktis b</p> <p>Börsil kaubeldavad kaubad, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL artikli 4 lõike 1 punkti 44 alapunktis b ja täpsustatud III lisa 2. jao tabelis 2.4</p> <p>Börsil kaubeldavad võlakirjad, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL artikli 4 lõike 1 punkti 44 alapunktis b ja täpsustatud III lisa 2. jao tabelis 2.4</p> | <p>Mittekapitaliinstrumentid</p> <p>„SDRV“ – väärtpaberistatud tuletisinstrumentid</p> <p>„SFPS“ – struktureeritud finantstooted</p> <p>„BOND“ – võlakirjad</p> <p>„ETCS“ – börsil kaubeldavad kaubad</p> <p>„ETNS“ – börsil kaubeldavad võlakirjad</p> <p>„EMAL“ – lubatud heitkoguste väärtpaberid</p> <p>„DERV“ – tuletisinstrument</p> |

| Nr | LAHTER | ESITATAVAD ANDMED | ARUANDE VORMING |
|----|--------------------|--|---|
| | | <p>Lubatud heitkoguste väärtpaberid, nagu on määratletud III lisa 12. jao tabelis 12.1</p> <p>Tuletisinstrumentid, nagu on määratletud direktiivi 2014/65/EL I lisa C jao punktides 4–10</p> | |
| 4 | Alusvara varaklass | Täidetakse, kui MiFIRi kohane tunnus on väärtpaberistatud tuletisinstrument või tuletisinstrument. | <p>„INTR“ – intressimäär</p> <p>„EQUI“ – aktsia</p> <p>„COMM“ – kaup</p> <p>„CRDT“ – krediit</p> <p>„CURR“ – valuuta</p> <p>„EMAL“ – lubatud heitkoguste väärtpaberid</p> <p>„OCTN“ – muu C10</p> |
| 5 | Lepingu liik | Täidetakse, kui MiFIRi kohane tunnus on tuletisinstrument. | <p>„OPTN“ – optsioonid</p> <p>„FUTR“ – futuurid (sh veoste forvardid)</p> <p>„FRAS“ – intressiforvardid</p> <p>„FORW“ – forvardid</p> <p>„SWAP“ – vahetustehingud</p> <p>„PSWP“ – portfelli vahetustehingud</p> <p>„SWPT“ – vahetusoptsioonid</p> <p>„OPTS“ – vahetustehingu optsioonid</p> <p>„FONS“ – vahetustehingu futuurid</p> <p>„FWOS“ – vahetustehingu forvardid</p> <p>„SPDB“ – hinna vahetustehingud veod „CFDS“ – hinna vahetustehingud lepingud</p> <p>„OTHR“ – muu</p> |
| 6 | Aruandepäev | Võrdlusandmete esitamise päev | {DATEFORMAT} |

| Nr | LAHTER | ESITATAVAD ANDMED | ARUANDE VORMING |
|----|---------------|--|-----------------|
| 7 | Kauplemiskoht | Kauplemiskoha puhul segmendi MIC (olemasolu korral) või muul juhul korraldaja MIC | {MIC} |
| 8 | Tähtaeg | Finanssinstrumenti määratud tähtaeg. Lahter täidetakse võlakirjade, intressimäära tuletisinstrumentide, aktsiatel põhinevate tuletisinstrumentide, kauba tuletisinstrumentide, välisvaluuta tuletisinstrumentide, krediituletisinstrumentide, C10 tuletisinstrumentide ja lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide varaklasside puhul. | {DATEFORMAT} |

Võlakirjadega (kõik võlakirjaliigid, v.a börsil kaubeldavad kaubad ja börsil kaubeldavad võlakirjad) seotud lahtrid

Selles jaos olevad lahtrid täidetakse üksnes võlakirjade puhul, nagu on määratletud III lisa 2. jao tabelis 2.1.

| | | | |
|----|----------------------|--|--|
| 9 | Võlakirjaliik | Võlakirjaliik, nagu on määratletud III lisa 2. jao tabelis 2.2. Täidetakse üksnes siis, kui MiFIRi kohane tunnus võrdub võlakirjadega. | „EUSB“ – riigivõlakiri „OEPB“ – muu avaliku sektori võlakiri „CVTB“ – vahetusvõlakiri „CVDB“ – pandikiri „CRPB“ – äriühingu võlakiri „OTHR“ – muu |
| 10 | Emiteerimise kuupäev | Kuupäev, millal võlakiri emiteeritakse ja hakkab koguma intressi. | {DATEFORMAT} |

Lubatud heitkoguste väärtpaberitega seotud lahtrid

Selles jaos olevad lahtrid täidetakse üksnes lubatud heitkoguste väärtpaberite puhul, nagu on määratletud III lisa 12. jao tabelis 12.1.

| | | | |
|----|--|----------------------------------|---|
| 11 | Lubatud heitkoguste väärtpaberite alamliik | Lubatud heitkoguste väärtpaberid | „CERE“ – THV „ERUE“ – HVÜ „EUAE“ – LHÜ „EUAA“ – lennunduse LHÜ „OTHR“ – muu |
|----|--|----------------------------------|---|

Tuletisinstrumentidega seotud lahtrid

Kauba tuletisinstrumentid ja C10 tuletisinstrumentid

Selles jaos olevad lahtrid täidetakse üksnes kauba tuletisinstrumentide puhul, nagu on määratletud III lisa 7. jao tabelis 7.1, ja C10 tuletisinstrumentide puhul, nagu on määratletud III lisa 10. jao tabelis 10.1.

| | | | |
|----|---|---|--|
| 12 | Veose alaliigiga seotud mahu määratlus | Täita, kui delegeeritud määruse (EL) 2017/585 lisa tabeli 2 lahtris 35 märgitud põhitoode võrdub veosega. | Kuivlasti puhul: „CAPE“ – Capesize „PNMX“ – Panamax „SPMX“ – Supramax „HAND“ – Handysize Vedellasti puhul: „CLAN“ – puhas „DRTY“ – must {ALPHANUM-4} muul juhul |
| 13 | Kindel marsruut või tähtajalise prahtimise keskmine | Täita, kui delegeeritud määruse (EL) 2017/585 lisa tabeli 2 lahtris 35 märgitud põhitoode võrdub veosega. | Vedellasti puhul: „TD7“ – TD7 „TD8“ – TD8 „TD17“ – TD17 „TD19“ – TD19 „TD20“ – TD20 „BLPG1“ – BLPG1 „TD3C“ – TD3C „TC2“ – TC2 „TC2_37“ – TC2_37 „TD3“ – TD3 „TC5“ – TC5 „TC6“ – TC6 „TC7“ – TC7 „TC9“ – TC9 „TC12“ – TC12 „TC14“ – TC14 „TC15“ – TC15 |

| | | | |
|----|------------------------------|---|--|
| | | | Kuivlasti puhul: „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} muul juhul |
| 14 | Tarne/sularahaarvelduse koht | Täita, kui delegeeritud määruse (EL) 2017/585 lisa tabeli 2 lahtris 35 märgitud põhitoode võrdub energiaga. | {EIC} elektri või maagaasi puhul „OTHR“ – muu |
| 15 | Tinglik valuuta | Valuuta, milles tinglik väärtus on nomineeritud. | {CURRENCYCODE_3} |

Intressimäära tuletisinstrumentid

Selles jaos olevad lahtrid täidetakse üksnes intressimäära tuletisinstrumentide puhul, nagu on määratletud III lisa 5. jao tabelis 5.1.

| | | | |
|----|---------------|---|---|
| 16 | Alusvara liik | Täidetakse lepinguliikide puhul, mis ei ole vahetustehingud, vahetusoptioonid, vahetustehingu futuurid ega vahetustehingu forvardid, ühega järgmistest variantidest ***** **** Täidetakse lepinguliikide puhul, mis on vahetustehingud, vahetusoptioonid, vahetustehingu optioonid, vahetustehingu futuurid ja vahetustehingu forvardid, seoses alusvaraks oleva vahetustehinguga ühega järgmistest variantidest | „BOND“ – võlakiri „BNDF“ – võlakirjafutuurid „INTR“ – intressimäär „IFUT“ – intressimäärafutuur ***** ** |
| | | | „FFMC“ – MITMES VALUUTAS UJUVA-MÄÄRUJUVA-MÄÄRA-VASTUVAHETUSTEHINGUD |

| | | | |
|----|---|---|--|
| | | | <p>„XFMC“ – MITMES VALUUTAS FIKSEERITUD-MÄÄR-UJUVA-MÄÄRA-VASTU-VAHETUSTEHINGUD</p> <p>„XXMC“ – MITMES VALUUTAS FIKSEERITUD-MÄÄR-FIKSEERITUD-MÄÄRA-VASTU-VAHETUSTEHINGUD</p> <p>„OSMC“ – MITMES VALUUTAS ÜLEÖÖ INTRESSIMÄÄRA VAHETUSTEHINGUD</p> <p>„IFMC“ – MITMES VALUUTAS INFLATSIOONIINDEKSIGA SEOTUD VAHETUSTEHINGUD</p> <p>„FFSC“ – ÜHES VALUUTAS UJUVA-MÄÄR-UJUVA-MÄÄRA-VASTU-VAHETUSTEHINGUD</p> <p>„XFSC“ – ÜHES VALUUTAS FIKSEERITUD-MÄÄR-UJUVA-MÄÄRA-VASTU-VAHETUSTEHINGUD</p> <p>„XXSC“ – ÜHES VALUUTAS FIKSEERITUD-MÄÄR-FIKSEERITUD-MÄÄRA-VASTU-VAHETUSTEHINGUD</p> <p>„OSSC“ – ÜHES VALUUTAS ÜLEÖÖ INTRESSIMÄÄRA VAHETUSTEHINGUD</p> <p>„IFSC“ – ÜHES VALUUTAS INFLATSIOONIINDEKSIGA SEOTUD VAHETUSTEHINGUD</p> |
| 17 | Alusvaraks oleva võlakirja emitent | Täidetakse, kui alusvara liik on võlakiri või võlakirjafutuur, märkides otsese või lõpliku alusvaraks oleva võlakirja emitendi juriidilise isiku tunnuse. | {LEI} |
| 18 | Alusvaraks oleva võlakirja tähtaeg | Lahtrisse märgitakse alusvaraks oleva võlakirja määratud tähtaeg. | {DATEFORMAT} |
| 19 | Alusvaraks oleva võlakirja emiteerimise kuupäev | Lahtrisse märgitakse alusvaraks oleva võlakirja emiteerimise kuupäev. | {DATEFORMAT} |
| 20 | Vahetusoptiooni tinglik valuuta | Täidetakse üksnes vahetusoptioonide puhul. | {CURRENCYCODE_3} |
| 21 | Alusvaraks oleva vahetustehingu tähtaeg | Täidetakse üksnes vahetusoptioonide, vahetustehingu optioonide, vahetustehingu futuuride ja vahetustehingu forvardite puhul. | {DATEFORMAT} |

| | | | |
|----|--|--|--|
| 22 | Inflatsiooniindeksi ISIN kood / alusvaraks oleva võlakirja ISIN kood | <p>Vahetusoptsoonide korral üks järgmistest alusvaraks oleva vahetustehingu liikidest: ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehing, ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forvardid, mitmes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehing, mitmes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingu futuurid/forvardid; kui inflatsiooniindeksil on ISIN, tuleb lahtrisse märkida selle indeksi ISIN kood.</p> <p>***** ***</p> <p>Võlakirjaoptsoonide, võlakirjaoptiooni optsoonide ja võlakirjafutuuri optsoonide puhul tuleb lahtrisse märkida lõpliku alusvaraks oleva võlakirja ISIN kood.</p> | <p>{ISIN}</p> <p>*****</p> <p>{ISIN}</p> |
| 23 | Inflatsiooniindeksi nimetus | Märgitakse indeksi standardnimetus vahetusoptsoonide korral, mis on seotud ühe järgmise aluseks oleva vahetustehingu liigiga: ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehing, ühes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingute futuurid/forvardid, mitmes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehing, mitmes valuutas inflatsiooniindeksiga seotud vahetustehingu futuurid/forvardid. | {ALPHANUM-25} |
| 24 | Viiteintressimäär | Viiteintressimäära nimi. | <p>{INDEX}</p> <p>või</p> <p>{ALPHANUM-25} kui indeksi nime ei ole nimekirjas {INDEX}</p> |
| 25 | Aluseks oleva intressimäära tähtaeg | <p>Sellesse lahtrisse märgitakse lepingu aluseks oleva intressimäära tähtaeg. Tähtaega väljendatakse päevades, nädalates, kuudes või aastates.</p> <p>Alustades suurimast tähtajühikust (aastad) ja liikudes väikseima suunas; kui intressimäära tähtaeg on täisarv, märgitakse sellesse lahtrisse selline standardtähtaeg.</p> | <p>{INTEGER-3}+ „DAYS“ – päevad</p> <p>{INTEGER-3}+ „WEEK“ – nädalad</p> <p>{INTEGER-3}+ „MNTH“ – kuud</p> <p>{INTEGER-3}+ „YEAR“ – aastad</p> |

Välisvaluuta tuletisinstrumentid

Selles jaos olevad lahtrid täidetakse üksnes välisvaluuta tuletisinstrumentide puhul, nagu on määratletud III lisa 8. jao tabelis 8.1.

| | | | |
|----|-----------------|---|---|
| 26 | Lepingu alaliik | Täita, et eristada ülekantavaid ja mitteülekantavaid forvardeid, optioone ning vahetustehinguid, nagu on määratletud III lisa 8. jao tabelis 8.1. | „DLVB“ – ülekantav „NDLV“ – mitteülekantav |
|----|-----------------|---|---|

Aktsiatel põhinevad tuletisinstrumentid

Lahtrid täidetakse üksnes aktsiatel põhinevate tuletisinstrumentide puhul, nagu on määratletud III lisa 6. jao tabelis 6.1.

| | | | |
|----|---------------|--|--|
| 27 | Alusvara liik | <p>Täita, kui MiFIRi kohane tunnus on tuletisinstrument, alusvara varaklass on aktsia ja varaklassi alamklass ei ole vahetustehing ega portfelli vahetustehing.</p> <p>*****</p> <p>Täita, kui MiFIRi kohane tunnus on tuletisinstrument, alusvara varaklass on aktsia ja varaklassi alamklass on kas vahetustehing või portfelli vahetustehing ning III lisa 6. jao tabeli 6.1 kohane segmenteerimiskriteerium 2 on üks alusvara.</p> | <p>„STIX“ – aktsia indeks</p> <p>„SHRS“ – aktsia</p> <p>„DIVI“ – dividendi indeks</p> <p>„DVSE“ – aktsiadi dividend</p> <p>„BSKT“ – korporatiivsetest sündmustest tulenevate aktsiate korb</p> <p>„ETFS“ – börsil kaubeldavad fondid</p> <p>„VOLI“ – volatiilsusindeks</p> <p>„OTHR“ – muu (sh hoidmistunnistused, sertifikaadid ja muu kapital, näiteks finantsinstrumentid)</p> <p>*****</p> <p>„SHRS“ – aktsia</p> <p>„DVSE“ – aktsiadi dividend</p> <p>„ETFS“ – börsil kaubeldavad fondid</p> <p>„OTHR“ – muu (sh hoidmistunnistused, sertifikaadid ja muu kapital, näiteks finantsinstrumentid)</p> |
|----|---------------|--|--|

| | | | |
|----|------------|---|---|
| | | <p>*****</p> <p>Täita, kui MiFIRi kohane tunnus on tuletisinstrument, alusvara varaklass on aktsia ja varaklassi alamklass on kas vahetustehing või portfelli vahetustehing ning III lisa 6. jao tabeli 6.1 kohane segmenteerimiskriteerium 2 on indeks.</p> <p>*****</p> <p>Täita, kui MiFIRi kohane tunnus on tuletisinstrument, alusvara varaklass on aktsia ja varaklassi alamklass on kas vahetustehing või portfelli vahetustehing ning III lisa 6. jao tabeli 6.1 kohane segmenteerimiskriteerium 2 on korv.</p> | <p>*****</p> <p>„STIX“ – aktsiaindeks</p> <p>„DIVI“ – dividendiindeks</p> <p>„VOLI“ – volatiilsusindeks</p> <p>„OTHR“ – muu</p> <p>*****</p> <p>„BSKT“ – korv</p> |
| 28 | Parameeter | Täita, kui MiFIRi kohane tunnus on tuletisinstrument, alusvara varaklass on aktsia ja varaklassi alamklass on üks järgmistest: vahetustehingud, portfelli vahetustehingud. | <p>„PRBP“ – hinna ja tulususe näitaja põhiparameeter (<i>price return basic performance parameter</i>)</p> <p>„PRDV“ – dividendi tulususe parameeter (<i>parameter return dividend</i>)</p> <p>„PRVA“ – tulususe variatsiooni parameeter (<i>parameter return variance</i>)</p> <p>„PRVO“ – tulususe volatiilsuse parameeter (<i>parameter return volatility</i>)</p> |

Hinnavahelepingud

Lahtrid täidetakse üksnes siis, kui lepingu liik on võrdne hinnavahelepingu või hinnavahekihlveoga.

| | | | |
|----|---------------|---|---|
| 29 | Alusvara liik | Täita üksnes siis, kui MiFIRi kohane tunnus on tuletisinstrument ja lepingu liik on võrdne hinnavahelepingu või hinnavahekihlveoga. | <p>„CURR“ – valuuta</p> <p>„EQUI“ – aktsia</p> <p>„BOND“ – võlakirjad</p> <p>„FTEQ“ – aktsiafutuurid/-forvardid</p> <p>„OPEQ“ – aktsioptsioonid</p> <p>„COMM“ – kaup</p> <p>„EMAL“ – lubatud heitkoguste väärtpaberid</p> <p>„OTHR“ – muu</p> |
|----|---------------|---|---|

| | | | |
|----|-------------------|--|------------------|
| 30 | Tinglik valuuta 1 | Aluseks olevate valuutade paari valuuta 1. Lahter on asjakohane, kui alusvara liik on valuuta. | {CURRENCYCODE_3} |
| 31 | Tinglik valuuta 2 | Aluseks olevate valuutade paari valuuta 2. Lahter on asjakohane, kui alusvara liik on valuuta. | {CURRENCYCODE_3} |

Krediituletisinstrumentid

Selles jaos olevad lahtrid täidetakse üksnes krediituletisinstrumentide puhul, nagu on määratletud III lisa 9. jao tabelis 9.1.

| | | | |
|----|---|---|--|
| 32 | Alusvaraks oleva krediidiriski vahetustehingu ISIN kood | Täidetakse krediidiriski vahetustehingu tuletisinstrumentide puhul, märkides alusvaraks oleva vahetustehingu ISIN koodi. | {ISIN} |
| 33 | Aluseks oleva indeksi kood | Täidetakse krediidiriski vahetustehingu indeksi tuletisinstrumentide puhul, märkides indeksi ISIN koodi. | {ISIN} |
| 34 | Aluseks oleva indeksi nimi | Täidetakse krediidiriski vahetustehingu indeksi tuletisinstrumentide puhul, märkides indeksi standardnimetuse. | {ALPHANUM-25} |
| 35 | Seeria | Indeksi koostise seerianumber, kui see on asjakohane. Täidetakse krediidiriski vahetustehingu indeksi või krediidiriski vahetustehingu indeksi tuletisinstrumentide puhul, märkides krediidiriski vahetustehingu indeksi seeria. | {DECIMAL-18/17} |
| 36 | Versioon | Seeria uus versioon antakse välja, kui üks koostisosadest satub viivitusse ja indeks tuleb ümber kujundada, et võtta arvesse kõikide koostisosade uut arvu indeksis. Täidetakse krediidiriski vahetustehingu indeksi või krediidiriski vahetustehingu indeksi tuletisinstrumentide puhul, märkides krediidiriski vahetustehingu indeksi versiooni. | {DECIMAL-18/17} |
| 37 | Uuendamise kuud (<i>roll months</i>) | Kõik kuud, mille jooksul eeldatakse uuendamist, nagu indeksi autor on asjaomasel aastal kehtestanud. Lahtrid tuleb täita iga uuendamise kuu kohta. Täidetakse krediidiriski vahetustehingu indeksi või krediidiriski vahetustehingu indeksi tuletisinstrumentide puhul. | „01“, „02“, „03“, „04“, „05“, „06“, „07“, „08“, „09“, „10“, „11“, „12“ |
| 38 | Järgmine uuendamise kuupäev | Täidetakse krediidiriski vahetustehingu indeksi või krediidiriski vahetustehingu indeksi tuletisinstrumentide puhul, märkides indeksi järgmise uuendamise kuupäeva, nagu indeksi autor on kehtestanud. | {DATEFORMAT} |

| | | | |
|----|--|--|---|
| 39 | Riigi ja avaliku sektori tüüpi emitent | Täidetakse, kui ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu või ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu tuletisinstrumenti aluseks olev üksus on avaliku sektori emitent, nagu on määratletud III lisa 9. jao tabelis 9.1. | „TRUE“ – aluseks olev üksus on riigi ja avaliku sektori tüüpi emitent „FALSE“ – aluseks olev üksus ei ole riigi ega avaliku sektori tüüpi emitent |
| 40 | Aluseks olev kohustus | Täidetakse ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu tuletisinstrumenti puhul, märkides aluseks oleva kohustuse ISIN koodi. | {ISIN} |
| 41 | Aluseks olev üksus | Märgitakse ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu või ühe alusvaraga krediidiriski vahetustehingu tuletisinstrumenti aluseks olev üksus. | {COUNTRYCODE_2} või ISO 3166-2 – kahekohaline riigikood, millele järgneb kriips („-“), ja kuni kolmekohaline tähtnumbriline riigi alljaotuse kood või {LEI} |
| 42 | Tinglik valuuta | Valuuta, milles tinglik väärtus on nomineeritud. | {CURRENCYCODE_3} |

Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentid

Selles jaos olevad lahtrid täidetakse üksnes lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide puhul, nagu on määratletud III lisa 13. jao tabelis 13.1.

| | | | |
|----|---|---|---|
| 43 | Lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide alamliik | Täita, kui muutuja nr 3 „MiFIRi kohane tunnus“ on „DERV“ – tuletisinstrument ja muutuja nr 4 „Alusvara varaklass“ on „EMAL“ – lubatud heitkoguste väärtpaberid. | „CERE“ – THV „ERUE“ – HVÜ „EUAE“ – LHÜ „EUAA“ – lennunduse LHÜ „OTHR“ – muu“. |
|----|---|---|---|

V LISA

„V LISA

Läbipaistvusarvutuste jaoks esitatavad kvantitatiivsed andmed

Tabel 1

Tabelis 2 kasutatavad tähised

| Tähis | Andmete liik | Määratlus |
|---------------|--|--|
| {ALPHANUM-n} | Kuni n tähtnumbrilist märki | Vabateksti lahter |
| {ISIN} | 12 tähtnumbrilist märki | ISIN kood, nagu on määratletud standardis ISO 6166 |
| {MIC} | 4 tähtnumbrilist märki | Turu tunnuscode, nagu on määratletud standardis ISO 10383 |
| {DATEFORMAT} | ISO 8601 kuupäevavorming | Kuupäevad tuleb esitada järgmisel kujul: AAAA-KK-PP |
| {DECIMAL-n/m} | Kuni n-kohaline kümnendarv, milles võib olla m kohta pärast koma | Lahtrisse kantakse kas positiivne või negatiivne arv: kümnekohtade eraldusmärk on punkt (.); negatiivsete arvude ees on miinus (-); väärtused ümardatakse, neid ei kärbita. |
| {INTEGER-n} | Kuni n-kohaline täisarv | Lahtrisse kantakse kas positiivne või negatiivne täisarv. |

Tabel 2

Mittekapitaliinstrumentide puhul likviidse turu, suuremahulisuse künnise ja finantsinstrumendile omase mahu künnise kindlaksmääramiseks esitatavate andmete üksikasjad

| Nr | Lahter | Esitatavad andmed | Täitmis- või avalikustamiskoha liik | Aruande vorming ja standardid |
|----|-------------------------------|---|--|-------------------------------|
| 1 | Finantsinstrumendi tunnuscode | Finantsinstrumendi tuvastamiseks kasutatav kood | Reguleeritud turg Mitmepoolne kauplemissüsteem Organiseeritud kauplemissüsteem Tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja Kauplemiskoondteabe pakkuja | {ISIN} |

| Nr | Lahter | Esitatavad andmed | Täitmis- või avalikustamiskoha liik | Aruande vorming ja standardid |
|----|-----------------------------|---|--|---|
| 2 | Täitmise kuupäev | Tehingute tegemise kuupäev | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | {DATEFORMAT} |
| 3 | Täitmiskoht | <p>Eli kauplemiskoha või süsteemse täitja segmendi MIC (olemasolu korral) või muul juhul korraldaja MIC</p> <p>Süsteemse täitja segmendi MIC (olemasolu korral) või muul juhul korraldaja MIC</p> <p>MIC-koodi XOFF börsiväliste tehingute puhul</p> <p>Tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustajad liidavad teatava ISINi ja täitmise kuupäeva puhul kõik selle instrumendiga seotud börsivälised kauplemistegevused üheks kogumiks (ISIN, XOFF, täitmise kuupäev).</p> | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | Kauplemiskoha või süsteemse täitja {MIC} või „XOFF“ |
| 4 | Peatatud instrumendi märgis | <p>Märge, kas instrument oli täitmise kuupäeval asjaomases kauplemiskohas kauplemiseks peatatud kogu päeva jooksul.</p> <p>Sellest tulenevalt märgitakse lahtrisse 5 väärtuseks null.</p> | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem | „TRUE“ – kui instrument oli peatatud kogu kauplemispäeva või „FALSE“ – kui instrument ei olnud peatatud kogu kauplemispäeva |
| 5 | Tehingute koguarv | <p>Täitmise kuupäeval tehtud tehingute koguarv.</p> <p>Tühistatud tehingud jäetakse esitatavatest andmetest välja.</p> <p>Tehinguid, mille suhtes kohaldatakse avalikustamisega viivitamist, arvestatakse andmeid esitavate üksuste esitatavates koondandmetes täitmise kuupäeva alusel.</p> <p>Lahter tuleb igal juhul täita väärtusega, mis on suurem kui null või sellega võrdne.</p> <p>Kogu päeva peatatud instrumentide puhul on lahtri väärtus null.</p> | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | {INTEGER-18} |
| 6 | Kogumaht | <p>Täitmise kuupäeval tehtud tehingute kogumaht.</p> <p>Mahtu mõõdetakse käesoleva määruse II lisa tabeli 4 kohaselt.</p> <p>Rahasummad esitatakse eurodes.</p> <p>Tühistatud tehingud jäetakse esitatavatest andmetest välja.</p> <p>Tehinguid, mille suhtes kohaldatakse avalikustamisega viivitamist, arvestatakse andmeid esitavate üksuste esitatavates koondandmetes täitmise kuupäeva alusel.</p> | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | {DECIMAL-18/5} |

| Nr | Lahter | Esitatavad andmed | Täitmis- või avalikustamiskoha liik | Aruande vorming ja standardid |
|----|---|---|--|-------------------------------|
| 7 | Tehingu suuruse vahemik | <p>Sellesse lahtrisse märgitakse käesoleva lisa tabelites 3 ja 4 esitatud väärtused.</p> <p>Tehingu suuruse vahemik, nagu on määratletud:</p> <p>lubatud heitkoguste väärtpaberite ja nende tuletisinstrumentide puhul käesoleva lisa tabelis 4;</p> <p>muude instrumentide puhul käesoleva lisa tabelis 3.</p> <p>Kogu päeva peatatud instrumentide puhul selle lahtri ning lahtritega 8 ja 9 seotud andmeid ei esitata.</p> | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | {ALPHANUM - -140} |
| 8 | Selles vahemikus tehtud tehingute koguarv | <p>Nende täitmise kuupäeval tehtud tehingute koguarv, mille suurus jääb vahemikku.</p> <p>Tühistatud tehingud jäetakse esitatavatest andmetest välja.</p> <p>Tehinguid, mille suhtes kohaldatakse avalikustamisega viivitamist, arvestatakse andmeid esitavate üksuste esitatavates koondandmetes täitmise kuupäeva alusel.</p> | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | {INTEGER-18} |
| 9 | Selles vahemikus kaubeldud kogumaht | <p>Kaubeldud kogumaht tähistab kõiki aruandepäeval tehtud tehinguid, mille suurus jääb vahemikku.</p> <p>Mahtu mõõdetakse käesoleva määruse II lisa tabeli 4 kohaselt.</p> <p>Rahasummad esitatakse eurodes.</p> <p>Tühistatud tehingud jäetakse esitatavatest andmetest välja.</p> <p>Tehinguid, mille suhtes kohaldatakse avalikustamisega viivitamist, arvestatakse andmeid esitavate üksuste esitatavates koondandmetes täitmise kuupäeva alusel.</p> | Reguleeritud turg, mitmepoolne kauplemissüsteem, organiseeritud kauplemissüsteem, tunnustatud kauplemisteabearuandluse avalikustaja, kauplemiskoondteabe pakkuja | {DECIMAL-18/5} |

Tabel 3

Tehingu suuruse vahemikud võlakirjade, struktureeritud finantstoodete, väärtpaperistatud tuletisinstrumentide, intressimäära tuletisinstrumentide, aktsiatel põhinevate tuletisinstrumentide, välisvaluuta tuletisinstrumentide, krediitituletisinstrumentide, kauba tuletisinstrumentide, C10 tuletisinstrumentide ja hinnavahelepingute puhul

| Ulatus | Tehingu suuruse vahemik | Määratlus |
|---|--------------------------|--|
| Tehingud, mille suurus on vahemikus 0 kuni 1,000,000 (v.a) |]0 – 100,000[| Tehingud, mille suurus on alla 100,000 euro |
| | [100,000 – 100,000] | Tehingud, mille suurus on võrdne 100,000 euroga |
| |]100,000 – 200,000[| Tehingud, mille suurus on üle 100,000 euro ja alla 200,000 euro |
| | [200,000 – 300,000[| Tehingud, mille suurus on üle 200,000 euro või sellega võrdne ja alla 300,000 euro |
| | [300,000 – 400,000[| Tehingud, mille suurus on üle 300,000 euro või sellega võrdne ja alla 400,000 euro |
| | [Y – Y + 100,000[| Tehingud, mille suurus on üle Y euro või sellega võrdne ja alla Y + 100,000 euro (100,000 euro suurune samm) |
| | [900,000 – 1,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle 900,000 euro või sellega võrdne ja alla 1,000,000 euro |
| Tehingud, mille suurus on vahemikus 1,000,000 (k.a) kuni 10,000,000 (v.a) | [1,000,000 – 1,500,000[| Tehingud, mille suurus on üle 1,000,000 euro või sellega võrdne ja alla 1,500,000 euro |
| | [1,500,000 – 2,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle 1,500,000 euro või sellega võrdne ja alla 2,000,000 euro |
| | [Z – Z + 500,000[| Tehingud, mille suurus on üle Z euro või sellega võrdne ja alla Z + 500,000 euro (500,000 euro suurune samm) |
| | [9,500,000 – 10,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle 9,500,000 euro või sellega võrdne ja alla 10,000,000 euro |

| Ulatus | Tehingu suuruse vahemik | Määratlus |
|---|-----------------------------|--|
| Tehingud, mille suurus on vahemikus 10,000,000 (k.a) kuni 100,000,000 (v.a) | [10,000,000 – 15,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle 10,000,000 euro või sellega võrdne ja alla 15,000,000 euro |
| | [15,000,000 – 20,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle 15,000,000 euro või sellega võrdne ja alla 20,000,000 euro |
| | [W – W + 5,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle W euro või sellega võrdne ja alla W + 5,000,000 euro (5,000,000 euro suurune samm) |
| | [95,000,000 – 100,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle 95,000,000 euro või sellega võrdne ja alla 100,000,000 euro |
| Tehingud, mille suurus on üle 100,000,000 või sellega võrdne | [100,000,000 – 125,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle 100,000,000 euro või sellega võrdne ja alla 125,000,000 euro |
| | [125,000,000 – 150,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle 125,000,000 euro või sellega võrdne ja alla 150,000,000 euro |
| | [X – X + 25,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle X euro või sellega võrdne ja alla X + 25,000,000 euro (25,000,000 euro suurune samm) |
| ... | ... | ... |

Tabel 4

Tehingu suuruse vahemikud lubatud heitkoguste väärtpaberite ja lubatud heitkoguste väärtpaberite tuletisinstrumentide puhul

| Ulatus | Tehingu suuruse vahemik | Määratlus |
|--|-------------------------|---|
| Tehingud, mille suurus on vahemikus 0 kuni 1,000,000 (v.a) |]0 – 100,000[| Tehingud, mille suurus alla 100,000 CO ₂ ekvivalenttonni |
| | [100,000 – 100,000] | Tehingud, mille suurus on võrdne 100,000 CO ₂ ekvivalenttonniga |
| |]100,000 – 200,000[| Tehingud, mille suurus on üle 100,000 CO ₂ ekvivalenttonni ja alla 200,000 CO ₂ ekvivalenttonni |
| | [200,000 – 300,000[| Tehingud, mille suurus on üle 200,000 CO ₂ ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 300,000 CO ₂ ekvivalenttonni |
| | [300,000 – 400,000[| Tehingud, mille suurus on üle 300,000 CO ₂ ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 400,000 CO ₂ ekvivalenttonni |
| | [Y – Y + 100,000[| Tehingud, mille suurus on üle Y CO ₂ ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla Y + 100,000 CO ₂ ekvivalenttonni (100,000 CO ₂ ekvivalenttonnine samm) |
| | [900,000 – 1,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle 900,000 CO ₂ ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 1,000,000 CO ₂ ekvivalenttonni |

| Ulatus | Tehingu suuruse vahemik | Määratlus |
|---|-----------------------------|---|
| Tehingud, mille suurus on vahemikus 1,000,000 (k.a) kuni 10,000,000 (v.a) | [1,000,000 – 1,500,000[| Tehingud, mille suurus on üle 1,000,000 CO ₂ ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 1,500,000 CO ₂ ekvivalenttonni |
| | [1,500,000 – 2,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle 1,500,000 CO ₂ ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 2,000,000 CO ₂ ekvivalenttonni |
| | [Z – Z + 500,000[| Tehingud, mille suurus on üle Z CO ₂ ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla Z + 500,000 CO ₂ ekvivalenttonni (500,000 CO ₂ ekvivalenttonnine samm) |
| | [9,500,000 – 10,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle 9,500,000 CO ₂ ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 10,000,000 CO ₂ ekvivalenttonni |
| Tehingud, mille suurus on vahemikus 10,000,000 (k.a) kuni 100,000,000 (v.a) | [10,000,000 – 15,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle 10,000,000 CO ₂ ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 15,000,000 CO ₂ ekvivalenttonni |
| | [15,000,000 – 20,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle 15,000,000 CO ₂ ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 20,000,000 CO ₂ ekvivalenttonni |
| | [W – W + 5,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle W CO ₂ ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla W + 5,000,000 CO ₂ ekvivalenttonni (5,000,000 CO ₂ ekvivalenttonnine samm) |
| | [95,000,000 – 100,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle 95,000,000 CO ₂ ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 100,000,000 CO ₂ ekvivalenttonni |
| Tehingud, mille suurus on üle 100,000,000 või sellega võrdne | [100,000,000 – 125,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle 100,000,000 CO ₂ ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 125,000,000 CO ₂ ekvivalenttonni |
| | [125,000,000 – 150,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle 125,000,000 CO ₂ ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla 150,000,000 CO ₂ ekvivalenttonni |
| | [X – X + 25,000,000[| Tehingud, mille suurus on üle X CO ₂ ekvivalenttonni või sellega võrdne ja alla X + 25,000,000 CO ₂ ekvivalenttonni (25,000,000 CO ₂ ekvivalenttonnine samm) |
| ... | ... | ...“ |

ISSN 1977-0650 (elektroniline väljaanne)
ISSN 1725-5082 (paberväljaanne)



Euroopa Liidu Väljaannete Talitus
L-2985 Luxembourg
LUKSEMBURG

ET