

Ovaj je tekst namijenjen isključivo dokumentiranju i nema pravni učinak. Institucije Unije nisu odgovorne za njegov sadržaj. Vjerodostojne inačice relevantnih akata, uključujući njihove preambule, one su koje su objavljene u Službenom listu Europske unije i dostupne u EUR-Lexu. Tim službenim tekstovima može se izravno pristupiti putem poveznica sadržanih u ovom dokumentu.

► **B** **DELEGIRANA UREDBA KOMISIJE (EU) 2017/583**

od 14. srpnja 2016.

o dopuni Uredbe (EU) br. 600/2014 Europskog parlamenta i Vijeća o tržištima financijskih instrumenata u pogledu regulatornih tehničkih standarda u vezi sa zahtjevima u pogledu transparentnosti za mjesta trgovanja i investicijska društva u odnosu na obveznice, strukturirane financijske proizvode, emisijske jedinice i izvedenice

(Tekst značajan za EGP)

(SL L 87, 31.3.2017., str. 229.)

Koju je izmijenila:

		Službeni list		
		br.	stranica	datum
► <u>M1</u>	Delegirana uredba Komisije (EU) 2021/529 od 18. prosinca 2020.	L 106	47	26.3.2021.
► <u>M2</u>	Delegirana uredba Komisije (EU) 2022/629 od 12. siječnja 2022.	L 115I	1	13.4.2022.
► <u>M3</u>	Delegirana uredba Komisije (EU) 2023/945 od 17. siječnja 2023.	L 131	17	16.5.2023.

**DELEGIRANA UREDBA KOMISIJE (EU) 2017/583**

od 14. srpnja 2016.

o dopuni Uredbe (EU) br. 600/2014 Europskog parlamenta i Vijeća o tržištima financijskih instrumenata u pogledu regulatornih tehničkih standarda u vezi sa zahtjevima u pogledu transparentnosti za mjesta trgovanja i investicijska društva u odnosu na obveznice, strukturirane financijske proizvode, emisijske jedinice i izvedenice

(Tekst značajan za EGP)

POGLAVLJE I.

DEFINICIJE

*Članak 1.***Definicije**

Za potrebe ove Uredbe primjenjuju se sljedeće definicije:

1. „paketna transakcija” znači jedno od sljedećeg:
 - (a) transakcija s ugovorom o izvedenicama ili drugim financijskim instrumentom koja je uvjetovana istodobnim izvršenjem transakcije s jednakovrijednom količinom odnosno fizičke imovine (zamjena instrumenta za fizičku imovinu);
 - (b) transakcija koja podrazumijeva izvršenje dviju ili više sastavnih transakcija s financijskim instrumentima i:
 - i. izvršava se između dviju ili više drugih ugovornih strana;
 - ii. svaka sastavnica transakcije ima značajan ekonomski ili financijski rizik koji je povezan sa svim drugim sastavnicama;
 - iii. izvršenje svake sastavnice istovremeno je i uvjetovano izvršenjem svih drugih sastavnica.
2. „sustav zahtjeva za ponude” znači sustav trgovanja u kojemu su ispunjeni sljedeći uvjeti:
 - (a) ponuda ili ponude člana ili sudionika dostavljaju se na temelju zahtjeva za ponude koji je podnio jedan ili više članova ili sudionika;
 - (b) ponudu može izvršiti isključivo član ili sudionik koji je podnio zahtjev;
 - (c) član ili sudionik na tržištu koji je podnio zahtjev može zaključiti transakciju prihvaćanjem ponude ili ponuda koje su mu dostavljene na zahtjev.
3. „sustav glasovnog trgovanja” znači sustav trgovanja u kojemu članovi transakcije dogovaraju glasovnim pregovaranjem.



POGLAVLJE II.

**TRANSPARENTNOST PRIJE TRGOVANJA ZA UREĐENA TRŽIŠTA
MULTILATERALNE TRGOVINSKE PLATFORME I ORGANIZIRANE
TRGOVINSKE PLATFORME***Članak 2.***Obveze u pogledu transparentnosti prije trgovanja**

(članak 8. stavci 1. i 2. Uredbe (EU) br. 600/2014)

Tržišni operateri i investicijska društva koji upravljaju mjestom trgovanja objavljuju raspon ponuda cijena za kupnju i prodaju te dubinu trgovinskog interesa po tim cijenama, u skladu s vrstom sustava trgovanja kojim upravljaju i zahtjevima za informacije navedenima u Prilogu I.

*Članak 3.***Nalozi velikog tržišnog obujma**

(članak 9. stavak 1. točka (a) Uredbe (EU) br. 600/2014)

Nalog ima veliki tržišni obujam u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta ako je, u trenutku unošenja naloga ili nakon njegove izmjene, jednak minimalnoj veličini naloga koja se utvrđuje u skladu s metodologijom iz članka 13. ili veći od te veličine.

*Članak 4.***Vrsta i minimalna veličina naloga koji su zaprimljeni u sustav za upravljanje nalogima**

(članak 9. stavak 1. točka (a) Uredbe (EU) br. 600/2014)

1. Vrsta naloga koji je zaprimljen u sustav za upravljanje nalogima mjesta trgovanja do njegova objavljivanja na tržištu na koji se može primijeniti izuzeće od obveza u pogledu transparentnosti prije trgovanja jest nalog:

- (a) koji se namjerava objaviti u knjizi naloga koju vodi mjesto trgovanja i ovisi o objektivnim uvjetima koji su unaprijed definirani protokolima sustava;
- (b) koji nije u interakciji s drugim trgovinskim interesima prije objavljivanja u knjizi naloga koju vodi mjesto trgovanja;
- (c) koji nakon objavljivanja u knjizi naloga dolazi u interakciju s drugim nalogima u skladu s pravilima koja se primjenjuju na naloge te vrste u trenutku objavljivanja.

2. Minimalna veličina naloga zaprimljenih u sustav za upravljanje nalogima mjesta trgovanja do njihova objavljivanja na tržištu na koje se može primijeniti izuzeće u pogledu obveza transparentnosti prije trgovanja, u trenutku unošenja i nakon izmjena naloga, jedna je od sljedećih:

▼ B

- (a) u slučaju naloga sa skrivenom količinom iznosi 10 000 EUR ili više;
- (b) za sve druge naloge veličina veća od minimalne količine kojom se može trgovati ili jednaka toj količini a koju unaprijed utvrđuje operater sustava u skladu sa svojim pravilima i protokolima.

3. Nalog sa skrivenom količinom iz stavka 2. točke (a) smatra se limitiranim nalogom koji se sastoji od objavljenog naloga koji se odnosi na dio određene količine i neobjavljenog naloga koji se odnosi na ostatak količine ako je neobjavljenu količinu moguće izvršiti tek nakon njezina objavljivanja u knjizi naloga kao novog objavljenog naloga.

▼ M3

4. Za potrebe stavka 2. točke (a) veličina naloga u sustavu za upravljanje nalogima mjeri se zamišljenim iznosom ugovora kojima se trguje kako je navedeno u Prilogu II. tablici 2. rubrici 10.

▼ B*Članak 5.***Veličina karakteristična za financijski instrument**

(članak 8. stavak 4. i članak 9. stavak 1. točka (b) Uredbe (EU) br. 600/2014)

1. Provediv iskaz interesa premašuje veličinu karakterističnu za financijski instrument ako je, u trenutku unošenja ili nakon izmjene, jednak ili veći od minimalne veličine provedivog iskaza interesa koja se utvrđuje u skladu s metodologijom iz članka 13.

2. Indikativne cijene prije trgovanja za provedive iskaze interesa koje premašuju veličinu karakterističnu za financijski instrument utvrđenu u skladu sa stavkom 1. te su manje od relevantnog velikog tržišnog obujma utvrđenog u skladu s člankom 3. smatraju se blizu cijenama trgovinskih interesa ako mjesto trgovanja objavi bilo što od sljedećega:

- (a) najbolju dostupnu cijena;
- (b) jednostavni prosjek cijena;
- (c) prosječnu cijenu ponderiranu volumenom, cijenom, vremenom ili brojem provedivih iskaza interesa.

3. Pri unosu i ažuriranju indikativnih cijena prije trgovanja tržišni operateri i investicijska društva koji upravljaju mjestom trgovanja objavljuju metodologiju za izračun cijena prije trgovanja i vrijeme objave.

▼B*Članak 6.***Razredi financijskih instrumenata za koje ne postoji likvidno tržište**

(članak 9. stavak 1. točka (c) Uredbe (EU) br. 600/2014)

Smatra se da za financijski instrument ili razred financijskih instrumenata ne postoji likvidno tržište ako je tako utvrđeno u skladu s metodologijom iz članka 13.

POGLAVLJE III.

TRANSPARENTNOST POSLIJE TRGOVANJA ZA MJESTA TRGOVANJA I INVESTICIJSKA DRUŠTVA KOJA TRGUJU IZVAN MJESTA TRGOVANJA*Članak 7.***Obveze u pogledu transparentnosti poslije trgovanja**

(članak 10. stavak 1. i članak 21. stavci 1. i 5. Uredbe (EU) br. 600/2014)

1. Investicijska društva koja ne trguju u skladu s pravilima mjesta trgovanja te tržišni operateri i investicijska društva koji upravljaju mjestom trgovanja objavljuju za svaku transakciju pojedinosti utvrđene u tablicama 1. i 2. Priloga II. i upotrebljavaju odgovarajuće oznake iz tablice 3. Priloga II.

2. Ako je prethodno objavljeno izvješće o trgovanju poništeno, investicijska društva koja trguju izvan mjesta trgovanja te tržišni operateri i investicijska društva koji upravljaju mjestom trgovanja objavljuju novo izvješće o trgovanju koje sadržava sve pojedinosti iz izvornog izvješća o trgovanju te oznaku za poništenje utvrđenu u tablici 3. Priloga II.

3. Ako je prethodno objavljeno izvješće o trgovanju izmijenjeno, investicijska društva koja trguju izvan mjesta trgovanja te tržišni operateri i investicijska društva koji upravljaju mjestom trgovanja objavljuju sljedeće informacije:

(a) novo izvješće o trgovanju koje sadržava sve pojedinosti iz izvornog izvješća o trgovanju te oznaku za poništenje utvrđenu u tablici 3. Priloga II.;

(b) novo izvješće o trgovanju koje sadržava sve pojedinosti iz izvornog izvješća o trgovanju u kojem su ispravljene sve potrebne pojedinosti te oznaku za izmjenu utvrđenu u tablici 3. Priloga II.

4. Informacije poslije trgovanja objavljuju se što je bliže moguće stvarnom vremenu, a u svakom slučaju:

(a) tijekom prve tri godine primjene Uredbe (EU) br. 600/2014, u roku od 15 minuta od izvršenja relevantne transakcije;

(b) nakon toga, u roku od pet minuta od izvršenja relevantne transakcije.

▼B

5. Ako transakcija između dvaju investicijskih društava nije zaključena u skladu s pravilima mjesta trgovanja, za vlastiti račun ili za račun klijenata, transakciju putem APA-e objavljuje samo investicijsko društvo koje prodaje dotični financijski instrument.

6. Odstupajući od stavka 5., ako je samo jedno od investicijskih društava koja su strane u transakciji sistematski internalizator za određeni financijski instrument i djeluje kao društvo koje kupuje, samo to društvo objavljuje transakciju putem APA-e, obavješćujući prodavatelja o poduzetim radnjama.

7. Investicijska društva poduzimaju sve razumne mjere kako bi osigurala da se transakcija objavi kao jedinstvena transakcija. U tu se svrhu dvije podudarajuće transakcije koje su sklopljene istodobno i po jednakoj cijeni uz posredovanje jedne ugovorne strane smatraju jedinstvenom transakcijom.

8. Informacije koje se odnose na paketnu transakciju objavljuju se u pogledu svih sastavnica što je tehnički moguće bliže stvarnom vremenu, uzimajući u obzir potrebu alokacije cijena određenim financijskim instrumentima i sadržavaju oznaku paketne transakcije ili oznaku transakcije zamjene instrumenta za fizičku imovinu kako je utvrđeno u tablici 3. Priloga II. Ako je paketna transakcija prihvatljiva za odgođeno objavljivanje u skladu s člankom 8., informacije o svim sastavnicama objavljuju se nakon što razdoblje odgode za transakciju prestane važiti.

*Članak 8.***Odgođeno objavljivanje transakcija**

(članak 11. stavci 1. i 3. i članak 21. stavak 4. Uredbe (EU) br. 600/2014)

1. Ako nadležno tijelo odobri odgođeno objavljivanje pojedinosti o transakcijama u skladu s člankom 11. stavkom 1. Uredbe (EU) br. 600/2014, investicijska društva koja trguju izvan mjesta trgovanja te tržišni operateri i investicijska društva koji upravljaju mjestom trgovanja objavljuju sve transakcije najkasnije u 19:00 sati po lokalnom vremenu drugog radnog dana od datuma transakcije, pod uvjetom da je ispunjen jedan od sljedećih uvjeta:

- (a) transakcija ima veliki tržišni obujam u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta kako je utvrđeno u članku 9.;
- (b) transakcija se odnosi na financijski instrument ili razred financijskih instrumenata za koji ne postoji likvidno tržište kako je utvrđeno u skladu s metodologijom iz članka 13.;
- (c) transakcija se izvršava između investicijskog društva koje trguje za vlastiti račun osim na temelju uparivanja naloga u skladu s člankom 4. stavkom 1. točkom 38. Direktive 2014/65/EU Europskog parlamenta i Vijeća ⁽¹⁾ i druge ugovorne strane te premašuje veličinu karakterističnu za instrument kako je navedeno u članku 10.;

⁽¹⁾ Direktiva 2014/65/EU Europskog parlamenta i Vijeća od 15. svibnja 2014. o tržištu financijskih instrumenata i izmjeni Direktive 2002/92/EZ i Direktive 2011/61/EU (SL L 173, 12.6.2014., str. 349.).

▼B

(d) transakcija je paketna transakcija koja ispunjuje jedan od sljedećih kriterija:

- i. jedna ili više njezinih sastavnica jesu transakcije financijskim instrumentima za koje ne postoji likvidno tržište;
- ii. jedna ili više njezinih sastavnica jesu transakcije financijskim instrumentima koje imaju veliki tržišni obujam u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta kako je utvrđeno u članku 9.;
- iii. transakcija se izvršava između investicijskog društva koje trguje za vlastiti račun osim na temelju uparivanja naloga u skladu s člankom 4. stavkom 1. točkom 38. Direktive 2014/65/EU i druge ugovorne strane, a jedna ili više njezinih sastavnica jesu transakcije financijskim instrumentima koje premašuju veličinu karakterističnu za instrument kako je utvrđeno u članku 10.

2. Nakon što rok za odgodu iz stavka 1. prestane važiti, objavljuju se sve pojedinosti o transakciji osim ako je u skladu s člankom 11. odobreno produženo ili neodređeno razdoblje odgode.

3. Ako se transakcija između dvaju investicijskih društava, za vlastiti račun ili za račun klijenta, ne izvršava u skladu s pravilima mjesta trgovanja, nadležno tijelo za potrebe utvrđivanja primjenjivog režima odgode nadležno je tijelo investicijskog društva odgovornog za objavljivanje transakcije putem APA-e u skladu s člankom 7. stavcima 5. 6. i 7.

*Članak 9.***Transakcije velikog tržišnog obujma**

(članak 11. stavak 1. točka (a) Uredbe (EU) br. 600/2014)

Smatra se da transakcija ima veliki tržišni obujam u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta ako je jednaka minimalnoj veličini transakcije ili veća od nje, pri čemu se ta veličina izračunava u skladu s metodologijom iz članka 13.

*Članak 10.***Veličina karakteristična za financijski instrument**

(članak 11. stavak 1. točka (c) Uredbe (EU) br. 600/2014)

Smatra se da transakcija premašuje veličinu karakterističnu za financijski instrument ako je jednaka minimalnoj veličini transakcije ili veća od nje, pri čemu se ta veličina izračunava u skladu s metodologijom iz članka 13.

▼B*Članak 11.***Zahtjevi u pogledu transparentnosti u vezi s odgođenim objavljivanjem koje odobravaju nadležna tijela**

(članak 11. stavak 3. Uredbe (EU) br. 600/2014)

1. Ako nadležna tijela izvršavaju svoje ovlasti u vezi s odobravanjem odgođenog objavljivanja u skladu s člankom 11. stavkom 3. Uredbe (EU) br. 600/2014, primjenjuje se sljedeće:

- (a) ako se primjenjuje članak 11. stavak 3. točka (a) Uredbe (EU) br. 600/2014, nadležna tijela zahtijevaju objavu bilo koje od sljedećih informacija tijekom cijelog razdoblja odgode kako je utvrđeno u članku 8.:
 - i. svih pojedinosti o transakciji utvrđenih u tablicama 1. i 2. Priloga II. uz iznimku pojedinosti koje se odnose na volumen;
 - ii. transakcije u zbirnom obliku po danu za najmanje pet transakcija izvršenih istoga dana, koje se objavljuju sljedećeg radnog dana prije 9:00 sati po lokalnom vremenu.
- (b) ako se primjenjuje članak 11. stavak 3. točka (b) Uredbe (EU) br. 600/2014, nadležna tijela dopuštaju da se volumen pojedinačne transakcije ne objavi tijekom produženog razdoblja od četiri tjedna.
- (c) u pogledu nevlasničkih instrumenata koji nisu državni dužnički instrumenti i ako se primjenjuje članak 11. stavak 3. točka (c) Uredbe (EU) br. 600/2014, nadležna tijela dopuštaju da se tijekom produženog razdoblja odgode od četiri tjedna nekoliko transakcija izvršenih tijekom jednog kalendarskog tjedna objavi u zbirnom obliku sljedećeg utorka prije 9:00 sati po lokalnom vremenu.
- (d) u pogledu državnih dužničkih instrumenata i ako se primjenjuje članak 11. stavak 3. točka (d) Uredbe (EU) br. 600/2014, nadležna tijela dopuštaju da se na neodređeno razdoblje nekoliko transakcija izvršenih tijekom jednog kalendarskog tjedna objavi u zbirnom obliku sljedećeg utorka prije 9:00 sati po lokalnom vremenu.

2. Ako je produženo razdoblje odgode iz stavka 1. točke (b) prestalo važiti, primjenjuju se sljedeći uvjeti:

- (a) u pogledu svih instrumenata koji nisu državni dužnički instrumenti, sve pojedinosti o svim pojedinačnim transakcijama objavljuju se sljedećeg radnog dana prije 9:00 sati po lokalnom vremenu;
- (b) u pogledu državnih dužničkih instrumenata, ako nadležna tijela odluče da mogućnosti predviđene člankom 11. stavkom 3. točkama (b) i (d) Uredbe (EU) br. 600/2014 neće uzastopno iskoristiti u skladu s člankom 11. stavkom 3. drugim podstavkom Uredbe (EU) br. 600/2014, sve pojedinosti o svim pojedinačnim transakcijama objavljuju se sljedećeg radnog dana prije 9:00 sati po lokalnom vremenu;

▼B

(c) u pogledu državnih dužničkih instrumenata, ako nadležna tijela mogućnosti predviđene člankom 11. stavkom 3. točkama (b) i (d) Uredbe (EU) br. 600/2014 primijene uzastopno u skladu s člankom 11. stavkom 3. drugim podstavkom Uredbe (EU) br. 600/2014, nekoliko transakcija izvršenih istog kalendarskog tjedna objavljuju se u zbirnom obliku u utorak prije 9:00 sati po lokalnom vremenu nakon što prestane važiti produženo razdoblje odgode od četiri tjedna koje počinje zadnjeg dana tog kalendarskog tjedna.

3. U pogledu svih instrumenata koji nisu državni dužnički instrumenti, sve pojedinosti o transakcijama na pojedinačnoj osnovi objavljuju se četiri tjedna od objave pojedinosti u zbirnom obliku u skladu sa stavkom 1. točkom (c) prije 9:00 sati po lokalnom vremenu.

4. Dnevni ili tjedni podaci u zbirnom obliku iz stavaka 1. i 2. sadržavaju sljedeće informacije za obveznice, strukturirane financijske proizvode, izvedenice i emisijske jedinice za svaki dan ili tjedan dotičnog kalendarskog razdoblja:

(a) ponderiranu prosječnu cijenu;

(b) ukupni volumen trgovanja kako je navedeno u tablici 4. Priloga II.;

(c) ukupan broj transakcija.

5. Transakcije se objedinjavaju prema oznaci ISIN. Ako oznaka ISIN nije dostupna, transakcije se objedinjavaju na razini razreda financijskih instrumenata na koji se primjenjuje test likvidnosti iz članka 13.

6. Ako dan u tjednu predviđen za objave iz stavka 1. točki (c) i (d) te stavaka 2. i 3. nije radni dan, objave se provode sljedeći radni dan prije 9:00 sati po lokalnom vremenu.

*Članak 12.***Primjena transparentnosti poslije trgovanja na određene transakcije izvršene izvan mjesta trgovanja**

(članak 21. stavak 1. Uredbe (EU) br. 600/2014)

Obveza objavljivanja volumena i cijena transakcija te vremena kad su sklopljene kako je utvrđeno u članku 21. stavku 1. Uredbe (EU) br. 600/2014 ne primjenjuje se na sljedeće:

(a) transakcije navedene u članku 2. stavku 5. Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/590 ⁽¹⁾;

⁽¹⁾ Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/590 od 28. srpnja 2016. o dopuni Uredbe (EU) br. 600/2014 Europskog parlamenta i Vijeća u pogledu regulatornih tehničkih standarda za izvješćivanje nadležnih tijela o transakcijama (vidjeti stranicu 449. ovoga Službenog lista).

▼B

- (b) transakcije koje izvršava društvo za upravljanje kako je definirano u članku 2. stavku 1. točki (b) Direktive 2009/65/EZ Europskog parlamenta i Vijeća ⁽¹⁾ ili upravitelj alternativnih investicijskih fondova kako je definiran u članku 4. stavku 1. točki (b) Direktive 2011/61/EU Europskog parlamenta i Vijeća ⁽²⁾, koji prenosi stvarno vlasništvo nad financijskim instrumentima s jednog subjekta za zajednička ulaganja na drugi, pri čemu ni jedno investicijsko društvo nije strana u transakciji;
- (c) „prepuštenu transakciju” ili „primljenu transakciju”, odnosno transakciju kod kojih investicijsko društvo prepusti transakciju klijenta drugom investicijskom društvu ili primi transakciju klijenta od drugog investicijskog društva za potrebe obrade poslije trgovanja;
- (d) prijenose financijskih instrumenata kao kolaterala u bilateralnim transakcijama ili u kontekstu maržnih ili kolateralnih zahtjeva središnje druge ugovorne strane ili kao dio postupka upravljanja neispunjenim obvezama središnje druge ugovorne strane.

POGLAVLJE IV.

ZAJEDNIČKE ODREDBE ZA TRANSPARENTNOST PRIJE TRGOVANJA I POSLIJE TRGOVANJA*Članak 13.***Metodologija za izračun transparentnosti**

(članak 9. stavci 1. i 2., članak 11. stavak 1. i članak 22. stavak 1. Uredbe (EU) br. 600/2014)

1. Za utvrđivanje financijskih instrumenata ili razreda financijskih instrumenata za koje ne postoji likvidno tržište za potrebe članka 6. i članka 8. stavka 1. točke (b) primjenjuju se sljedeće metodologije u svim razredima imovine:

- (a) statično utvrđivanje likvidnosti za:
 - i. razred imovine sekuritiziranih izvedenica kako je definirano u tablici 4.1. Priloga III.;
 - ii. sljedeće podrazrede imovine vlasničkih izvedenica: opcije na dioničke indekse, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na dioničke indekse, opcije na dionice, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na dionice, opcije na dividendu dionice, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na dividendu dionice, opcije na indeks dividendi, budućnosnice/terminski ugovori koje se odnose na indeks dividendi, opcije na indeks volatilnosti, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na indeks volatilnosti, opcije na fondove čijim se udjelima trguje na burzi, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na fondove čijim se udjelima trguje na burzi i druge vlasničke izvedenice kako je definirano u tablici 6.1. Priloga III.;

⁽¹⁾ Direktiva 2009/65/EZ Europskog parlamenta i Vijeća od 13. srpnja 2009. o usklađivanju zakona i drugih propisa u odnosu na subjekte za zajednička ulaganja u prenosive vrijednosne papire (UCITS) (SL L 302, 17.11.2009., str. 32.).

⁽²⁾ Direktiva 2011/61/EU Europskog parlamenta i Vijeća od 8. lipnja 2011. o upraviteljima alternativnih investicijskih fondova i o izmjeni direktiva 2003/41/EZ i 2009/65/EZ te uredbi (EZ) br. 1060/2009 i (EU) br. 1095/2010 (SL L 174, 1.7.2011., str. 1.).

▼B

- iii. razred imovine valutnih izvedenica kako je definirano u tablici 8.1. Priloga III.;
 - iv. podrazrede imovine drugih kamatnih izvedenica, drugih robnih izvedenica, drugih kreditnih izvedenica, drugih C10 izvedenica, drugih ugovora za razlike (CFD-ova), drugih emisijskih jedinica i drugih izvedenica emisijskih jedinica kako je definirano u tablicama 5.1., 7.1., 9.1., 10.1., 11.1., 12.1. i 13.1. Priloga III.
- (b) periodička procjena na temelju kvantitativnih i, ako je primjenjivo, kvalitativnih kriterija likvidnosti za:
- i. sve vrste obveznica osim robe kojom se trguje na burzi (ETC-ovi) i dužničkih instrumenata kojima se trguje na burzi (ETN-ovi) kako je definirano u tablici 2.1. Priloga III. i kako je dodatno utvrđeno u članku 17. stavku 1.;
 - ii. vrste obveznica ETC i ETN kako je definirano u tablici 2.4. Priloga III.;
 - iii. razred imovine kamatnih izvedenica osim podrazreda imovine drugih kamatnih izvedenica kako je definirano u tablici 5.1. Priloga III.;
 - iv. sljedeće podrazrede imovine vlasničkih izvedenica: ugovori o razmjeni i ugovori o razmjeni na razini portfelja kako je definirano u tablici 6.1. Priloga III.;
 - v. razred imovine robnih izvedenica osim podrazreda imovine drugih robnih izvedenica kako je definirano u tablici 7.1. Priloga III.;
 - vi. sljedeće podrazrede imovine kreditnih izvedenica: indeksni ugovori o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza i ugovori o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza jednog subjekta kako je definirano u tablici 9.1. Priloga III.;
 - vii. razred imovine C10 izvedenica osim podrazreda imovine drugih C10 izvedenica kako je definirano u tablici 10.1. Priloga III.;
 - viii. sljedeće podrazrede imovine ugovora za razlike (CFD): valutni CFD-ovi i robni CFD-ovi kako je definirano u tablici 11.1. Priloga III.;
 - ix. razred imovine emisijskih jedinica osim podrazreda imovine drugih emisijskih jedinica kako je definirano u tablici 12.1. Priloga III.;
 - x. razred imovine izvedenica emisijskih jedinica osim podrazreda imovine drugih izvedenica emisijskih jedinica kako je definirano u tablici 13.1. Priloga III.;
- (c) periodička procjena na temelju kvalitativnih kriterija likvidnosti za:
- i. sljedeće podrazrede imovine kreditnih izvedenica: opcije na indeks CDS-ova i opcije na CDS jednog subjekta kako je definirano u tablici 9.1. Priloga III.;

▼B

- ii. sljedeće podrazrede imovine ugovora za razlike (CFD): vlasnički CFD-ovi, CFD-ovi koji se odnose na obveznice, CFD-ovi koji se odnose na vlasničke budućnosnice/terminalske ugovore i CFD-ovi koji se odnose na vlasničke opcije kako je definirano u tablici 11.1. Priloga III.
- (d) periodička procjena na temelju metodologije koja se sastoji od dva testa za strukturirane financijske proizvode kako je definirano u tablici 3.1. Priloga III.
2. Za utvrđivanje veličine karakteristične za financijski instrument iz članka 5. i za naloge velikog tržišnog obujma u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta iz članka 3. primjenjuju se sljedeće metodologije:
- (a) granična vrijednost za:
- i. vrste obveznica ETC i ETN kako je definirano u tablici 2.5. Priloga III.;
 - ii. razred imovine sekuritiziranih izvedenica kako je definirano u tablici 4.2. Priloga III.;
 - iii. sve podrazrede vlasničkih izvedenica kako je definirano u tablicama 6.2. i 6.3. Priloga III.;
 - iv. sve podrazrede valutnih izvedenica kako je definirano u tablici 8.2. Priloga III.;
 - v. sve podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u pogledu razreda imovine kamatnih izvedenica, robnih izvedenica, kreditnih izvedenica, C10 izvedenica i ugovora za razlike (CFD) kako je definirano u tablicama 5.3., 7.3., 9.3., 10.3. i 11.3. Priloga III.;
 - vi. sve podrazrede imovine za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u pogledu razreda imovine emisijskih jedinica i izvedenica emisijskih jedinica kako je definirano u tablicama 12.3. i 13.3. Priloga III.;
 - vii. sve strukturirane financijske proizvode ako nije uspješno proveden test 1 u skladu sa stavkom 1. točkom (d) kako je definirano u tablici 3.2. Priloga III.;
 - viii. sve strukturirane financijske proizvode za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište ako je uspješno proveden samo test 1 u skladu sa stavkom 1. točkom (d) kako je definirano u tablici 3.3. Priloga III.
- (b) veličina transakcije ispod koje se nalazi postotak transakcija koja odgovara percentilu trgovanja kako je dodatno utvrđeno u članku 17. stavku 3. i granična vrijednost, ovisno o tome koja je vrijednost veća, za:
- i. sve vrste obveznica osim ETC-ova i ETN-ova kako je definirano u tablici 2.3. Priloga III.;
 - ii. sve podrazrede s likvidnim tržištem za razrede imovine kamatnih izvedenica, robnih izvedenica, kreditnih izvedenica, C10 izvedenica i ugovora za razlike (CFD) kako je definirano u tablicama 5.2., 7.2., 9.2., 10.2. i 11.2. Priloga III.;

▼B

- iii. sve podrazrede imovine s likvidnim tržištem za razrede imovine emisijskih jedinica i izvedenica emisijskih jedinica kako je definirano u tablicama 12.2. i 13.2. Priloga III.;
 - iv. sve strukturirane financijske proizvode za koje se smatra da postoji likvidno tržište ako su uspješno provedeni test 1 i test 2 u skladu sa stavkom 1. točkom (d) kako je definirano u tablici 3.3. Priloga III.
3. Za utvrđivanje veličine karakteristične za financijski instrument iz članka 8. stavka 1. točke (c) i za transakcije velikog tržišnog obujma u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta iz članka 8. stavka 1. točke (a) primjenjuju se sljedeće metodologije:
- (a) granična vrijednost za:
 - i. vrste obveznica ETC i ETN kako je definirano u tablici 2.5. Priloga III.;
 - ii. razred imovine sekuritiziranih izvedenica kako je definirano u tablici 4.2. Priloga III.;
 - iii. sve podrazrede vlasničkih izvedenica kako je definirano u tablicama 6.2. i 6.3. Priloga III.;
 - iv. sve podrazrede valutnih izvedenica kako je definirano u tablici 8.2. Priloga III.;
 - v. sve podrazrede za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u pogledu razreda imovine kamatnih izvedenica, robnih izvedenica, kreditnih izvedenica, C10 izvedenica i ugovora za razlike (CFD) kako je definirano u tablicama 5.3., 7.3., 9.3., 10.3. i 11.3. Priloga III.;
 - vi. sve podrazrede imovine za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u pogledu razreda imovine emisijskih jedinica i izvedenica emisijskih jedinica kako je definirano u tablicama 12.3. i 13.3. Priloga III.;
 - vii. sve strukturirane financijske proizvode ako nije uspješno proveden test 1 u skladu sa stavkom 1. točkom (d) kako je definirano u tablici 3.2. Priloga III.;
 - viii. sve strukturirane financijske proizvode za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište ako je uspješno proveden samo test 1 u skladu sa stavkom 1. točkom (d) kako je definirano u tablici 3.3. Priloga III.
 - (b) veličina transakcije ispod koje se nalazi postotak transakcija koja odgovara percentilu trgovanja za sve vrste obveznica, osim ETC-ova i ETN-ova, kako je definirano u tablici 2.3. Priloga III.;
 - (c) veličina transakcije ispod koje se nalazi postotak transakcija koja odgovara percentilu trgovanja, veličina transakcije ispod koje se nalazi postotak volumena koja odgovara percentilu volumena i granična vrijednost, ovisno o tome koja je vrijednost najveća, za sve podrazrede za koje se smatra da imaju likvidno tržište u pogledu razreda imovine kamatnih izvedenica, robnih izvedenica, kreditnih izvedenica, C10 izvedenica i ugovora za razlike (CFD-ova) kako je predviđeno u tablicama 5.2., 7.2., 9.2., 10.2. i 11.2. Priloga III.;

▼ B

(d) veličina transakcije ispod koje se nalazi postotak transakcija koja odgovara percentilu trgovanja i granična vrijednost, ovisno o tome koja je vrijednost veća, za:

- i. sve podrazrede imovine za koje se smatra da postoji likvidno tržište u pogledu razreda imovine emisijskih jedinica i izvedenica emisijskih jedinica kako je definirano u tablicama 12.2. i 13.2. Priloga III.;
- ii. sve strukturirane financijske proizvode za koje se smatra da postoji likvidno tržište ako su uspješno provedeni test 1 i test 2 u skladu sa stavkom 1. točkom (d) kako je definirano u tablici 3.3. Priloga III.

4. Za potrebe stavka 3. točke (c), ako je veličina transakcije koja odgovara percentilu volumena za utvrđivanje transakcije koja ima veliki tržišni obujam u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta veća od 97,5 percentila trgovanja, volumen trgovanja ne uzima se u obzir, a veličina karakteristična za financijski instrument iz članka 8. stavka 1. točke (c) i veličina transakcija velikog tržišnog obujma u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta iz članka 8. stavka 1. točke (a) utvrđuju se kao veličina transakcije ispod koje se nalazi postotak transakcija koja odgovara percentilu trgovanja i granična vrijednost, ovisno o tome koja je vrijednost veća.

5. U skladu s Delegiranom uredbom (EU) 2017/590 i Delegiranom uredbom (EU) 2017/577 nadležna tijela od mjesta trgovanja, APA-a i CTP-ova svakodnevno prikupljaju podatke koji su potrebni za izvršavanje izračuna za utvrđivanje:

- (a) financijskih instrumenata i razreda financijskih instrumenata za koje ne postoji likvidno tržište kako je utvrđeno u stavku 1.;
- (b) veličine velikog tržišnog obujma u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta i veličine karakteristične za instrument kako je utvrđeno u stavcima 2. i 3.

▼ M3

Podaci iz prvog podstavka prikupljaju se u skladu s Prilogom V.

▼ B

6. Nadležna tijela koja provode izračune za razred financijskih instrumenata utvrđuju aranžmane za međusobnu suradnju kako bi se osiguralo objedinjavanje podataka u Uniji koji su potrebni za izračune.

7. Za potrebe stavka 1. točki (b) i (d), stavka 2. točke (b) i stavka 3. točki (b), (c) i (d) nadležna tijela u obzir uzimaju transakcije izvršene u Uniji od 1. siječnja do 31. prosinca prethodne godine.

8. Veličina transakcije za potrebe stavka 2. točke (b) i stavka 3. točki (b), (c) i (d) utvrđuje se na temelju mjere volumena kako je definirano u tablici 4. Priloga II. Ako se veličina transakcije definirana za potrebe stavaka 2. i 3. izražava u monetarnoj vrijednosti, a financijski instrument nije denominiran u eurima, veličina transakcije preračunava se u valutu u kojoj je denominiran financijski instrument primjenom referentnog tečaja za euro Europske središnje banke od 31. prosinca prethodne godine.

▼B

9. Tržišni operateri i investicijska društva koji upravljaju mjestom trgovanja mogu veličine transakcija utvrđene u skladu sa stavcima 2. i 3. preračunati u odgovarajući broj jedinica koje je unaprijed odredilo to mjesto trgovanja za predmetni podrazred ili podrazred imovine. Tržišni operateri i investicijska društva koji upravljaju mjestom trgovanja mogu primjenjivati te veličine transakcije sve do primjene rezultata sljedećih izračuna koji se provode u skladu sa stavkom 17.

10. Iz izračuna navedenih u stavku 2. točki (b) podtočki i. te stavku 3. točki (b) isključuju se transakcije čija veličina iznosi 100 000 eura ili manje.

11. Za potrebe utvrđivanja iz stavaka 2. i 3., stavak 2. točka (b) i stavak 3. točke (b), (c) i (d) ne primjenjuju se kad je broj transakcija koje se uzimaju u obzir u izračunima manji od 1 000, a u tom se slučaju primjenjuju sljedeći pragovi:

(a) 100 000 EUR za sve vrste obveznica osim ETC-ova i ETN-ova;

(b) granične vrijednosti definirane u stavku 2. točki (a) i stavku 3. točki (a) za sve financijske instrumente koji nisu obuhvaćeni točkom (a) ovog stavka.

12. Osim kad se odnose na emisijske jedinice ili njihove izvedenice, izračuni iz stavka 2. točke (b) i stavka 3. točki (b), (c) i (d) zaokružuju se na sljedeće iznose:

(a) 100 000 ako granična vrijednost iznosi manje od 1 milijun;

(b) 500 000 ako granična vrijednost iznosi 1 milijun ili više, ali manje od 10 milijuna;

(c) 5 milijuna ako granična vrijednost iznosi 10 milijuna ili više, ali manje od 100 milijuna;

(d) 25 milijuna ako granična vrijednost iznosi 100 milijuna ili više.

13. Za potrebe stavka 1. kvantitativni kriteriji likvidnosti navedeni za svaki razred imovine u Prilogu III. utvrđuju se u skladu s odjeljkom 1. Priloga III.

14. Za vlasničke izvedenice koje su uvrštene za trgovanje ili se njima prvi put trguje na mjestu trgovanja, a koje ne pripadaju podrazredu za koji su objavljene veličina karakteristična za financijski instrument iz članka 5. i članka 8. stavka 1. točke (c) te veličina naloga i transakcija velikog tržišnog obujma u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta iz članka 3. i članka 8. stavka 1. točke (a) te koje pripadaju jednom od podrazreda imovine navedenih u stavku 1. točki (a) podtočki ii., veličina karakteristična za financijski instrument i veličina naloga i transakcija velikog tržišnog obujma u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta jesu veličine koje su primjenjive na kategoriju najmanjeg prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) podrazreda imovine kojem pripada vlasnička izvedenica.

▼ B

15. Za financijske instrumente koji su uvršteni za trgovanje ili se njima prvi put trguje na mjestu trgovanja, a koji ne pripadaju podrazredu za koji su objavljene veličina karakteristična za financijski instrument iz članka 5. i članka 8. stavka 1. točke (c) te veličina naloga i transakcija velikog tržišnog obujma u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta iz članka 3. i članka 8. stavka 1. točke (a) smatra se da likvidno tržište ne postoji sve do primjene rezultata izračuna provedenih u skladu sa stavkom 17. Primjenjiva veličina karakteristična za financijski instrument iz članka 5. i članka 8. stavka 1. točke (c) te veličina naloga i transakcija velikog tržišnog obujma u odnosu na uobičajenu veličinu tržišta iz članka 3. i članka 8. stavka 1. točke (a) jesu veličine podrazreda za koje je utvrđeno da nemaju likvidno tržište koji pripadaju istom podrazredu imovine.

16. Nakon završetka dana trgovanja, ali prije kraja tog dana, mjesta trgovanja nadležnim tijelima dostavljaju pojediniosti uključene u Prilog IV. za provedbu izračuna iz stavka 5. kad god se financijski instrument uvrštava za trgovanje ili se njime prvi put trguje na tom mjestu trgovanja ili kad god se izmijene prethodno dostavljene pojediniosti.

▼ M3

17. Nadležna tijela osiguravaju da se rezultati izračuna iz stavka 5. za svaki financijski instrument i razred financijskog instrumenta objave do 30. travnja godine od datuma početka primjene Uredbe (EU) br. 600/2014 i do 30. travnja svake sljedeće godine. Rezultati izračuna primjenjuju se od prvog ponedjeljka u lipnju svake godine nakon objave do dana prije prvog ponedjeljka u lipnju sljedeće godine.

18. Za potrebe izračuna iz stavka 1. točke (b) podtočke i. te odstupajući od stavaka 7., 15. i 17., nadležna tijela u pogledu obveznica osim ETC-a i ETN-a osiguravaju da se izračuni iz stavka 5. točke (a) objavljuju na tromjesečnoj osnovi prvog ponedjeljka u veljači, svibnju, kolovozu i studenome od datuma početka primjene Uredbe (EU) br. 600/2014 te prvog ponedjeljka u veljači, svibnju, kolovozu i studenome svake sljedeće godine. Izračuni uključuju transakcije izvršene u Uniji tijekom prethodnog kalendarskog tromjesečja i primjenjuju se od trećeg ponedjeljka u veljači, svibnju, kolovozu i studenome svake godine do početka primjene izračuna za sljedeće tromjesečno razdoblje.

▼ B

19. Za obveznice, osim ETC-ova i ETN-ova, koje su uvrštene za trgovanje ili se njima prvi put trguje na mjestu trgovanja tijekom prva dva mjeseca tromjesečja smatra se da likvidno tržište postoji kako je utvrđeno u tablici 2.2. Priloga III. sve do primjene rezultata izračuna za kalendarsko tromjesečje.

20. Za obveznice, osim ETC-ova i ETN-ova, koje su uvrštene za trgovanje ili se njima prvi put trguje na mjestu trgovanja tijekom zadnjeg mjeseca tromjesečja smatra se da postoji likvidno tržište kako je utvrđeno u tablici 2.2. Priloga III. sve do primjene rezultata izračuna za sljedeće kalendarsko tromjesečje.

*Članak 14.***Transakcije na koje se primjenjuje izuzeće iz članka 1. stavka 6. Uredbe (EU) br. 600/2014**

(članak 1. stavak 6. Uredbe (EU) br. 600/2014)

Smatra se da je član Europskog sustava središnjih banaka (ESSB) sklopio transakciju u okviru provedbe monetarne politike, devizne politike i politike financijske stabilnosti ako ta transakcija ispunjava sljedeće uvjete:

- (a) transakcija se izvršava za potrebe monetarne politike, uključujući operaciju koja se izvršava u skladu s člancima 18. i 20. Statuta Europskog sustava središnjih banaka i Europske središnje banke koji je priložen Ugovoru o Europskoj uniji ili operaciju koja se izvršava u okviru jednakovrijednih nacionalnih odredbi za članove ESSB-a u državama članicama čija valuta nije euro;
- (b) transakcija je devizna operacija, uključujući operacije koje se izvršavaju radi držanja službenih valutnih pričuva država članica ili upravljanja njima ili uslugu upravljanja pričuvama koju pruža član ESSB-a središnjim bankama u drugim zemljama za koje je razdoblje odgode produljeno u skladu s člankom 1. stavkom 9. Uredbe (EU) br. 600/2014.;
- (c) transakcija se izvršava za potrebe politike financijske stabilnosti.

*Članak 15.***Transakcije na koje se ne primjenjuje izuzeće iz članka 1. stavka 6. Uredbe (EU) br. 600/2014**

(članak 1. stavak 7. Uredbe (EU) br. 600/2014)

Članak 1. stavak 6. Uredbe (EU) br. 600/2014 ne primjenjuje se na sljedeće vrste transakcija koje je sklopio član ESSB-a radi izvršenja operacije ulaganja koja nije povezana s izvršavanjem jednog od zadataka iz članka 14. od strane tog člana:

- (a) transakcije koje se sklapaju radi upravljanja kapitalom;
- (b) transakcije koje se sklapaju u administrativne svrhe ili za potrebe osoblja člana ESSB-a, a uključuju transakcije koje se sklapaju u svojstvu upravitelja mirovinskog sustava za osoblje;
- (c) transakcije koje član sklapa za potrebe portfelja ulaganja u skladu s obvezama u okviru nacionalnog prava.

▼B*Članak 16.***Privremena suspenzija obveza u pogledu transparentnosti**

(članak 9. stavak 5. točka (a) Uredbe (EU) br. 600/2014)

1. Za financijske instrumente za koje postoji likvidno tržište u skladu s metodologijom iz članka 13., nadležno tijelo može privremeno suspendirati obveze utvrđene u člancima 8. i 10. Uredbe (EU) br. 600/2014 ako za razred obveznica, strukturiranih financijskih proizvoda, emisijskih jedinica ili izvedenica ukupni volumen kako je definiran u tablici 4. Priloga II. izračunan za prethodnih 30 kalendarskih dana čini manje od 40 % prosječnog mjesečnog volumena izračunanog za punih 12 mjeseci prije tih 30 kalendarskih dana.

2. Za financijske instrumente za koje ne postoji likvidno tržište u skladu s metodologijom iz članka 13., nadležno tijelo može privremeno suspendirati obveze iz članka 8. i 10. Uredbe (EU) br. 600/2014 ako za razred obveznica, strukturiranih financijskih proizvoda, emisijskih jedinica ili izvedenica ukupni volumen kako je definiran u tablici 4. Priloga II. izračunan za prethodnih 30 kalendarskih dana čini manje od 20 % prosječnog mjesečnog volumena izračunanog za punih 12 mjeseci prije tih 30 kalendarskih dana.

3. Pri provedbi izračuna iz stavaka 1. i 2. nadležna tijela uzimaju u obzir transakcije izvršene na svim mjestima trgovanja u Uniji za dotični razred obveznica, strukturiranih financijskih proizvoda, emisijskih jedinica ili izvedenica. Izračuni se provode na razini razreda financijskih instrumenata na koji se primjenjuje test likvidnosti iz članka 13.

4. Prije nego što donesu odluku o suspenziji obveza u pogledu transparentnosti, nadležna tijela osiguravaju da značajan pad u likvidnosti na svim mjestima trgovanja nije posljedica sezonskih učinaka relevantnog razreda financijskih instrumenata na likvidnost.

*Članak 17.***Odredbe koje se odnose na procjenu likvidnosti za obveznice i utvrđivanje pragova za veličinu karakterističnu za instrument prije trgovanja na temelju percentila trgovanja****▼M2**

1. Za utvrđivanje obveznica za koje ne postoji likvidno tržište za potrebe članka 6. i u skladu s metodologijom iz članka 13. stavka 1. točke (b), pristup za kriterij likvidnosti „prosječni dnevni broj transakcija” upotrebljava se primjenom „prosječnog dnevnog broja transakcija” koji odgovara fazi S3 (sedam dnevnih transakcija).

▼B

2. Za korporativne obveznice i pokrivene obveznice koje su uvrštene za trgovanje ili se njima prvi put trguje na mjestu trgovanja smatra se da likvidno tržište postoji sve do primjene rezultata izračuna likvidnosti za prvo tromjesečje kako je navedeno u članku 13. stavku 18. ako:

- (a) veličina izdavanja veća je od 1 000 000 000 EUR u fazama S1 i S2, kako je utvrđeno u skladu sa stavkom 6.;
- (b) veličina izdavanja veća je od 500 000 000 EUR u fazama S3 i S4, kako je utvrđeno u skladu sa stavkom 6.;

▼M2

3. Za utvrđivanje veličine karakteristične za financijski instrument za potrebe članka 5. i u skladu s metodologijom iz članka 13. stavka 2. točke (b) podtočke i., pristup za percentil trgovanja koji treba primijeniti upotrebljava se primjenom percentila trgovanja koji odgovara fazi S3 (50. percentil).

Za utvrđivanje veličine karakteristične za financijski instrument za potrebe članka 5. i u skladu s metodologijom iz članka 13. stavka 2. točke (b) podtočaka od ii. do iv., pristup za percentil trgovanja koji treba primijeniti upotrebljava se primjenom percentila trgovanja koji odgovara fazi S1 (30. percentil).

▼B

4. Do 30. srpnja godine od datuma početka primjene Uredbe (EU) br. 600/2014 i do 30. srpnja svake sljedeće godine ESMA Komisiji dostavlja procjenu funkcioniranja praga za kriterij likvidnosti „prosječni dnevni broj transakcija” za obveznice te percentila trgovanja kojima se utvrđuje veličina karakteristična za financijske instrumente obuhvaćene stavkom 8. Obveza dostavljanja procjene funkcioniranja praga za kriterij likvidnosti za obveznice prestaje važiti nakon što se dosegne S4 u slijedu iz stavka 6. Obveza dostavljanja procjene percentila trgovanja prestaje važiti nakon što se dosegne S4 iz slijeda iz stavka 8.

5. U procjeni iz stavka 4. u obzir se uzimaju:

- (a) kretanje volumena trgovanja nevlasničkim instrumentima obuhvaćenima obvezama u pogledu transparentnosti prije trgovanja u skladu s člancima 8. i 9. Uredbe (EU) br. 600/2014.;
- (b) učinak percentila pragova koji se primjenjuju za utvrđivanje veličine karakteristične za financijski instrument na pružatelje likvidnosti; i
- (c) svi drugi relevantni čimbenici.

6. Uzimajući u obzir procjenu provedenu u skladu sa stavicima 4. i 5., ESMA Komisiji dostavlja izmijenjenu verziju regulatornog tehničkog standarda u kojem se prag za kriterij likvidnosti „prosječni dnevni broj transakcija” za obveznice prilagođava u skladu sa sljedećim slijedom:

- (a) S2 (deset dnevnih transakcija) do 30. srpnja godine od datuma početka primjene Uredbe (EU) br. 600/2014;

▼ B

(b) S3 (sedam dnevnih transakcija) do 30. srpnja sljedeće godine; i

(c) S4 (dvije dnevne transakcije) do 30. srpnja sljedeće godine.

7. Ako ESMA ne dostavi izmijenjeni regulatorni tehnički standard kojim se prag prilagođava na sljedeću fazu u skladu sa slijedom iz stavka 6., u procjeni ESMA-e provedenoj u skladu sa stavcima 4. i 5. objašnjava se zašto prilagodba praga na odgovarajuću sljedeću fazu nije opravdana. U tom se slučaju prijelaz u sljedeću fazu odgađa za jednu godinu.

8. Uzimajući u obzir procjenu provedenu u skladu sa stavcima 4. i 5., ESMA Komisiji dostavlja izmijenjenu verziju regulatornog tehničkog standarda u kojem se prag za percentile trgovanja prilagođava u skladu sa sljedećim slijedom:

(a) S2 (40. percentil) do 30. srpnja godine od datuma početka primjene Uredbe (EU) br. 600/2014;

(b) S3 (50. percentil) do 30. srpnja sljedeće godine; i

(c) S4 (60. percentil) do 30. srpnja sljedeće godine.

9. Ako ESMA ne dostavi izmijenjeni regulatorni tehnički standard kojim se prag prilagođava na sljedeću fazu u skladu sa slijedom iz stavka 8., u procjeni ESMA-e provedenoj u skladu sa stavcima 4. i 5. objašnjava se zašto prilagodba praga na odgovarajuću sljedeću fazu nije opravdana. U tom se slučaju prijelaz u sljedeću fazu odgađa za jednu godinu.

Članak 18.

Prijelazne odredbe

1. Najkasnije šest mjeseci prije datuma početka primjene Uredbe (EU) br. 600/2014 nadležna tijela prikupljaju potrebne podatke, provode izračune i osiguravaju objavu pojedinosti iz članka 13. stavka 5.

2. Za potrebe stavka 1.:

(a) izračuni se temelje na šestomjesečnom referentnom razdoblju koje počinje 18 mjeseci prije datuma početka primjene Uredbe (EU) br. 600/2014;

(b) rezultati izračuna navedeni u prvoj objavi upotrebljavaju se do početka primjene rezultata prvih redovnih izračuna iz članka 13. stavka 17.

3. Odstupajući od stavka 1., u pogledu svih obveznica osim ETC-ova i ETN-ova, nadležna tijela ulažu najveće napore kako bi osigurala da se rezultati izračuna u pogledu transparentnosti iz članka 13. stavka 1. točke (b) podtočke i. objave najkasnije prvog dana mjeseca koji pretходи datumu početka primjene Uredbe (EU) br. 600/2014, na temelju tromjesečnog referentnog razdoblja koje počinje prvog dana petog mjeseca prije datuma početka primjene Uredbe (EU) br. 600/2014.

▼B

4. Nadležna tijela, tržišni operateri i investicijska društva uključujući investicijska društva koja upravljaju mjestom trgovanja upotrebljavaju informacije objavljene u skladu sa stavkom 3. sve do primjene rezultata prvog redovnog izračuna iz članka 13. stavka 18.

5. Za obveznice, osim ETC-ova i ETN-ova, koje su uvrštene za trgovanje ili se njima prvi put trguje na mjestu trgovanja u razdoblju od tri mjeseca prije datuma početka primjene Uredbe (EU) br. 600/2014 smatra se da likvidno tržište ne postoji kako je navedeno u tablici 2.2. Priloga III. sve do primjene rezultata prvog redovnog izračuna iz članka 13. stavka 18.

*Članak 19.***Stupanje na snagu i primjena**

Ova Uredba stupa na snagu dvadesetog dana od dana objave u *Službenom listu Europske unije*.

Primjenjuje se od 3. siječnja 2018.

Ova je Uredba u cijelosti obvezujuća i izravno se primjenjuje u svim državama članicama.



PRILOG I.

Opis vrste sustava i povezanih informacija koje se objavljuju u skladu s člankom 2.

Informacije koje se objavljuju u skladu s člankom 2.

Vrsta sustava	Opis sustava	Informacije koje se objavljuju
Sustav trgovanja koji se temelji na knjizi naloga i neprekinutoj dražbi	Sustav u okviru kojeg se s pomoću knjige naloga i algoritma trgovanja koji djeluje bez ljudske intervencije nalozi za prodaju uparaju s naložima za kupnju na temelju najbolje raspoložive cijene na kontinuiranoj osnovi.	Za svaki financijski instrument ukupan broj naloga i volumena koji su predstavljeni na svakoj cjenovnoj razini za najmanje pet cjenovno najpovoljnijih ponuda za kupnju i prodaju.
Sustav trgovanja koji se temelji na ponudama	Sustav u kojem se transakcije zaključuju na temelju obvezujućih ponuda koje su neprekidno na raspolaganju sudionicima, što od održavatelja tržišta zahtijeva da ponude održava na razinama koje odražavaju ravnotežu između potreba članova i sudionika za trgovanjem na komercijalnoj razini i rizika kojima se održavatelj tržišta izlaže.	Za svaki financijski instrument cjenovno najpovoljnija ponuda za kupnju i prodaju svakog održavatelja tržišta za taj instrument, zajedno s volumenima povezanim s tim cijenama. Objavljene ponude predstavljaju obvezujuće ponude za kupnju ili prodaju financijskih instrumenata te se u njima navode cijena i volumen financijskih instrumenata koje su registrirani održavatelji tržišta spremni kupiti ili prodati. U iznimnim tržišnim uvjetima, moguće je dopustiti indikativne ili jednostrane cijene tijekom ograničenog razdoblja.
Sustav trgovanja koji se temelji na periodičnim dražbama	Sustav koji uparuje naloge na temelju periodičnih dražbi i algoritma trgovanja, koji djeluje bez ljudske intervencije.	Za svaki financijski instrument cijena po kojoj bi sustav trgovanja koji se temelji na dražbama najbolje zadovoljio uvjete svojeg algoritma trgovanja i volumen koji bi sudionici u tom sustavu eventualno mogli izvršiti po toj cijeni.
Sustav trgovanja koji se temelji na zahtjevima za ponude	Sustav trgovanja u kojem se ponuda ili ponude dostavljaju na temelju zahtjeva za ponude koji je podnio jedan ili više članova ili sudionika. Ponudu može izvršiti isključivo član ili sudionik na tržištu koji je podnio zahtjev. Član ili sudionik koji je podnio zahtjev može zaključiti transakciju prihvatanjem ponude ili ponuda koje su mu dostavljene na zahtjev.	Ponude i povezani volumeni bilo kojeg člana ili sudionika koji bi u slučaju prihvatanja podrazumijevali transakciju na temelju pravila sustava. Sve ponude dostavljene na temelju zahtjeva za ponude mogu se objaviti istodobno, ali najkasnije kada postanu izvršive.
Sustav glasovnog trgovanja	Sustav trgovanja u kojemu članovi transakcije dogovaraju glasovnim pregovaranjem.	Ponude i povezani volumeni bilo kojeg člana ili sudionika koji bi u slučaju prihvatanja podrazumijevali transakciju na temelju pravila sustava.
Sustavi trgovanja koji ne pripadaju vrstama iz prvih pet redaka	Hibridni sustav koji obuhvaća dvije ili više vrsta iz prvih pet redaka ili sustav u kojemu je utvrđivanje cijene drugačije u odnosu na ono koje se primjenjuje na vrste sustava iz prvih pet redaka.	Odgovarajuće informacije o razini naloga ili ponuda i trgovinskog interesa; prije svega, pet cjenovno najpovoljnijih ponuda za kupnju i prodaju i/ili istovremenih ponuda svakog održavatelja tržišta za navedeni instrument, ako obilježja mehanizma utvrđivanja cijene to omogućuju.



PRILOG II.

Pojediniosti o transakcijama koje se stavljaju na raspolaganje javnosti

Tablica 1.

Tablica s oznakama za tablicu 2.

OZNAKA	VRSTA PODATKA	DEFINICIJA
{ALPHANUM-n}	Do n alfanumeričkih znakova	Rubrika za slobodan unos teksta.
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerička znaka	Troslovnna oznaka države, kako je definirano u valutnim oznakama u skladu s normom ISO 4217
{DATE_TIME_FORMAT}	Format datuma i vremena u skladu s normom ISO 8601	Datum i vrijeme u sljedećem formatu: GGGG-MM-DDTss:mm:ss.ddddddZ. pri čemu je: — „GGGG” je godina; — „MM” je mjesec; — „DD” je dan; — „T” – znači da se upotrebljava slovo „T” — „ss” je sat; — „mm” je minuta; — „ss.dddddd” je sekunda i dio sekunde; — Z je UTC vrijeme. Datumi i vremena navode se u UTC formatu.
{DECIMAL-n/m}	Decimalni broj od ukupno najviše n znamenki od kojih najviše m znamenki može biti dio decimalne	Numeričko polje za pozitivne i negativne vrijednosti. — decimalni razdjelnik je „.” (točka); — negativni znakovi imaju predznak „-” (minus); Vrijednosti se, prema potrebi, zaokružuju, a ne skraćuju.
{ISIN}	12 alfanumerička znaka	Oznaka ISIN, kako je definirano u normi ISO 6166
{MIC}	4 alfanumerička znaka	Identifikacijska oznaka tržišta, kako je definirano u normi ISO 10383

Tablica 2.

Popis podataka za potrebe transparentnosti poslije trgovanja

Pojediniosti	Financijski instrumenti	Opis/podaci koji se objavljuju	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format koji se upotrebljava kako je definirano u tablici 1.
Datum i vrijeme trgovanja	Za sve financijske instrumente	Datum i vrijeme kada je transakcija izvršena.	Uređeno tržište (RM), multi-lateralna trgovinska platforma (MTP), organizirana trgovinska platforma (OTP)	{DATE_TIME_FORMAT}

▼ B

Pojedinosti	Financijski instrumenti	Opis/podaci koji se objavljuju	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format koji se upotrebljava kako je definirano u tablici 1.
		<p>Za transakcije koje su izvršene na mjestu trgovanja razina preciznosti u skladu je sa zahtjevima iz članka 3. Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/574 ⁽¹⁾.</p> <p>Za transakcije koje nisu izvršene na mjestu trgovanja, datum i vrijeme kada su strane dogovorile sadržaj sljedećih rubrika: količina, cijena, valute (u rubrikama 31, 34 i 40 kako je navedeno u tablici 2. Priloga I. Delegiranoj uredbi (EU) 2017/590, identifikacijska oznaka instrumenta, razred instrumenta i oznaka odnosnog instrumenta, ako je primjenjivo. Za transakcije koje nisu izvršene na mjestu trgovanja razina preciznosti navedenog vremena mora biti barem najbliža sekunda.</p> <p>Ako je transakcija izvršena na temelju naloga koji je društvo za izvršenje za račun klijenta prenijelo trećoj strani, pri čemu uvjeti prijenosa navedeni u članku 5. Delegirane uredbe (EU) 2017/590 nisu ispunjeni, navode se datum i vrijeme same transakcije, a ne vrijeme prijenosa naloga.</p>	<p>Ovlašteni sustav objavljivanja (APA)</p> <p>Pružatelj konsolidiranih podataka o trgovanju (CTP)</p>	
Vrsta identifikacijske oznake instrumenta	Za sve financijske instrumente	Vrsta oznake koja se upotrebljava za identifikaciju financijskog instrumenta	RM, MTP, OTP APA CTP	„ISIN” = oznaka ISIN, ako je ISIN dostupan „OTHR” = ostale identifikacijske oznake
Identifikacijska oznaka instrumenta	Za sve financijske instrumente	Oznaka koja se upotrebljava za identifikaciju financijskog instrumenta	RM, MTP, OTP APA CTP	{ISIN} Ako identifikacijska oznaka instrumenta nije ISIN, identifikacijska oznaka kojom se označuje izvedeni instrument u skladu s rubrikama 3 do 5, 7, 8 i 12 do 42 kako je utvrđeno u Prilogu IV. i rubrikama 13 i 24 do 48 kako je utvrđeno u Prilogu Delegiranoj uredbi (EU) 2017/585 i grupiranjem izvedenih instrumenata kako je utvrđeno u Prilogu III.

▼ B

Pojedinosti	Financijski instrumenti	Opis/podaci koji se objavljuju	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format koji se upotrebljava kako je definirano u tablici 1.
Cijena	Za sve financijske instrumente	<p>Cijena izvršenja transakcije koja, ako je primjenjivo, ne uključuje proviziju i obračunate kamate.</p> <p>U slučaju ugovora o opciji riječ je o premiji ugovora o izvedenicama po odnosnom instrumentu ili indeksnom bodu.</p> <p>U slučaju oklada na raspone (<i>spread bets</i>) riječ je o referentnoj cijeni odnosnog instrumenta.</p> <p>U slučaju ugovora o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjava obveza riječ je o kuponu izraženom u baznim bodovima.</p> <p>Ako je cijena izražena u monetarnoj vrijednosti, iskazuje se u glavnoj valutnoj jedinici.</p> <p>Ako cijena trenutačno nije dostupna, ali će to postati, vrijednost bi trebala biti „PNDG”.</p> <p>Ako cijena nije primjenjiva, rubrika se ne popunjava.</p> <p>Informacije koje se navode u ovoj rubrici moraju biti u skladu s vrijednosti navedenoj u rubrici „Količina”.</p>	RM, MTP, OTP APA CTP	<p>{DECIMAL-18/13} ako je cijena izražena u monetarnoj vrijednosti</p> <p>{DECIMAL-11/10} ako je cijena izražena u postotku ili prinosu</p> <p>„PNDG” ako cijena nije dostupna</p> <p>{DECIMAL-18/17} ako je cijena izražena u baznim bodovima</p>
Mjesto izvršenja	Za sve financijske instrumente	<p>Identifikacija mjesta izvršenja na kojem je izvršena transakcija.</p> <p>Oznaka MIC segmenta u skladu s normom ISO 10383 upotrebljava se za transakcije izvršene na mjestu trgovanja. Ako oznaka MIC segmenta ne postoji, upotrebljava se operativni MIC.</p> <p>Oznaka MIC „XOFF” upotrebljava se za financijske instrumente uvrštene za trgovanje ili kojima se trguje na mjestu trgovanja, ako se transakcija s tim financijskim instrumentom ne izvršava na mjestu trgovanja, putem sistematskog internalizatora ili organizirane trgovinske platforme izvan Unije.</p> <p>Oznaka SINT upotrebljava se za financijski instrument uvršten za trgovanje ili kojim se trguje na mjestu trgovanja, ako se transakcija s tim financijskim instrumentom izvršava putem sistematskog internalizatora.</p>	RM, MTP, OTP APA CTP	<p>{MIC} – mjesta trgovanja</p> <p>„SINT” – sistematski internalizator</p>

▼ B

Pojedinosti	Financijski instrumenti	Opis/podaci koji se objavljuju	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format koji se upotrebljava kako je definirano u tablici 1.
Označivanje cijene	Za sve financijske instrumente	Naznaka o tome izražava li se cijena u monetarnoj vrijednosti, postotku ili prinosu	RM, MTP, OTP APA CTP	„MONE” – monetarna vrijednost „PERC” – postotak „YIEL” – prinos „BAPO” – bazni bodovi
Valuta cijene	Za sve financijske instrumente	Valuta u kojoj je cijena izražena (primjenjivo ako je cijena izražena u monetarnoj vrijednosti).	RM, MTP, OTP APA CTP	{CURRENCYCODE_3}
Oznaka količine izražene u mjernoj jedinici	Za robne izvedenice, izvedenice emisijskih jedinica i emisijske jedinice osim u slučajevima opisanima u članku 11. stavku 1. točkama (a) i (b) ove Uredbe.	Oznaka mjernih jedinica u kojima je izražena količina u mjernim jedinicama	RM, MTP, OTP APA CTP	„TOCD” – tone ekvivalenta ugljikovog dioksida ili {ALPHANUM-25} drugo
Količina u mjernim jedinicama	Za robne izvedenice, izvedenice emisijskih jedinica i emisijske jedinice osim u slučajevima opisanima u članku 11. stavku 1. točkama (a) i (b) ove Uredbe.	Istovjetan iznos robe ili emisijskih jedinica kojima se trguje izraženo u mjernoj jedinici	RM, MTP, OTP APA CTP	{DECIMAL-18/17}
Količina	Za sve financijske instrumente osim u slučajevima opisanima u članku 11. stavku 1. točkama (a) i (b) ove Uredbe.	Broj jedinica financijskog instrumenta ili broj ugovora o izvedenicama u transakciji.	RM, MTP, OTP APA CTP	{DECIMAL-18/17}
Zamišljeni iznos	Za sve financijske instrumente osim u slučajevima opisanima u članku 11. stavku 1. točkama (a) i (b) ove Uredbe.	Nominalni iznos ili zamišljeni iznos U slučaju oklada na raspone (<i>spread bets</i>) zamišljeni iznos jednak je monetarnoj vrijednosti uloga po promjeni boda u odnosnom financijskom instrumentu.	RM, MTP, OTP APA CTP	{DECIMAL-18/5}

▼ B

Pojedinosti	Financijski instrumenti	Opis/podaci koji se objavljuju	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format koji se upotrebljava kako je definirano u tablici 1.
		<p>U slučaju ugovora o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza riječ je o zamišljenom iznosu za koji se stječe ili prodaje zaštita.</p> <p>Informacije koje se navode u ovoj rubrici moraju biti u skladu s vrijednostima navedenima u rubrici „Cijena”.</p>		
Valuta zamišljene vrijednosti	Za sve financijske instrumente osim u slučajevima opisanima u članku 11. stavku 1. točkama (a) i (b) ove Uredbe.	Valuta u kojoj je zamišljena vrijednost denominirana.	RM, MTP, OTP APA CTP	{CURRENCYCODE_3}
Vrsta	Samo za emisijske jedinice i izvedenice emisijskih jedinica	Rubrika se primjenjuje samo na emisijske jedinice i izvedenice emisijskih jedinica.	RM, MTP, OTP APA CTP	„EUAE” – EUA „CERE” – CER „ERUE” – ERU „EUAA” – EUAA „OTHR” – ostalo (samo za izvedenice)
Datum i vrijeme objave	Za sve financijske instrumente	<p>Datum i vrijeme kada je mjesto trgovanja ili APA objavilo transakciju.</p> <p>Za transakcije koje su izvršene na mjestu trgovanja razina preciznosti u skladu je sa zahtjevima iz članka 2. Delegirane uredbe (EU) 2017/574.</p> <p>Za transakcije koje nisu izvršene na mjestu trgovanja razina preciznosti navedenog vremena mora biti barem najbliža sekunda.</p>	RM, MTP, OTP APA CTP	{DATE_TIME_FORMAT}
Mjesto objave	Za sve financijske instrumente	Oznaka koja se upotrebljava za identifikaciju mjesta trgovanja i APA-e koji objavljuju transakciju.	CTP	Mjesto trgovanja {MIC}



Pojedinosti	Financijski instrumenti	Opis/podaci koji se objavljuju	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format koji se upotrebljava kako je definirano u tablici 1.
				APA: {MIC} ako je primjenjivo. U protivnome oznaka od 4 znaka kako je objavljena na popisu pružatelja usluga dostave podataka na <i>web-mjestu</i> ESMA-e.
Identifikacijska oznaka transakcije	Za sve financijske instrumente	Alfanumerička oznaka koju dodjeljuju mjesta trgovanja (u skladu s člankom 12. Delegirane uredbe Komisije (EU) 2017/580 ⁽²⁾) i APA-e te koja se koristi u svim naknadnim upućivanjima na tu određenu transakciju. Identifikacijska oznaka transakcije mora biti jedinstvena, dosljedna i nepromijenjena za oznaku MIC segmenta u skladu s normom ISO10383 i po danu trgovanja. Ako mjesto trgovanja ne upotrebljava oznaku MIC segmenta, identifikacijska oznaka transakcije mora biti jedinstvena, dosljedna i nepromijenjena za oznaku operativni MIC i po danu trgovanja. Ako APA ne upotrebljava oznake MIC, identifikacijska oznaka trebala bi biti jedinstvena, dosljedna i nepromijenjena za oznaku od 4 znaka kojom se identificira APA i po danu trgovanja. Komponente identifikacijske oznake transakcije ne smiju otkrivati identitet drugih ugovornih strana u transakciji za koju se oznaka vodi.	RM, MTP, OTP APA CTP	{ALPHANUMERICAL-52}
Transakcija koju treba poravnati	Za izvedenice	Oznaka kojom se navodi hoće li se transakcija poravnati.	RM, MTP, OTP APA CTP	„true” – transakcija će se poravnati „false” – transakcija se neće poravnati

⁽¹⁾ Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/574 od 7. lipnja 2016. o dopuni Direktive 2014/65/EU Europskog parlamenta i Vijeća u pogledu regulatornih tehničkih standarda za razinu točnosti satova poslovanja (vidjeti stranicu 148. ovoga Službenog lista).

⁽²⁾ Delegirana uredba Komisije (EU) 2017/580 od 24. lipnja 2016. o dopuni Uredbe (EU) br. 600/2014 Europskog parlamenta i Vijeća u pogledu regulatornih tehničkih standarda za evidentiranje relevantnih podataka u vezi s nalogima koji se odnose na financijske instrumente (vidjeti stranicu 193. ovoga Službenog lista).



Tablica 3.

Popis oznaka za potrebe transparentnosti poslije trgovanja

	Oznaka	Naziv oznake	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Opis
	„BENC”	Oznaka transakcije koja se temelji na referentnoj vrijednosti	RM, MTP, OTP APA CTP	Sve vrste transakcija koje se temelje na prosječnoj cijeni ponderiranoj volumenom i sve druge transakcije za koje se cijena izračunava u više navrata u skladu s određenom referentnom vrijednošću.
	„ACTX”	Oznaka aplikativne transakcije (<i>Agency cross transaction</i>)	APA CTP	Transakcije kod kojih investicijsko društvo poveže naloge klijenata pri čemu se kupnja i prodaja provode kao jedna transakcija i s istim volumenom i cijenom.
	„NPFT”	Oznaka transakcije kojom se ne pridonosi utvrđivanju cijena	RM, MTP, OTP CTP	Sve vrste transakcije popisanih u članku 12. ove Uredbe i kojima se ne pridonosi utvrđivanju cijena.
	„LRGS”	Oznaka transakcije velikog tržišnog obujma poslije trgovanja	RM, MTP, OTP APA CTP	Transakcije izvršene na temelju odgode objave za veliki tržišni obujam poslije trgovanja.
	„ILQD”	Oznaka transakcije s nelikvidnim instrumentom	RM, MTP, OTP APA CTP	Transakcije izvršene na temelju odgode objave za instrumente za koje ne postoji likvidno tržište.
	„SIZE”	Oznaka transakcije veličine karakteristične za instrument poslije trgovanja	RM, MTP, OTP APA CTP	Transakcije izvršene na temelju odgode objave za veličinu karakterističnu za instrument poslije trgovanja.
	„TPAC”	Oznaka paketne transakcije	RM, MTP, OTP APA CTP	Paketne transakcije koje nisu razmjena instrumenta za fizičku imovinu kako je definirano u članku 1.
	„XFPH”	Oznaka transakcije razmjene instrumenta za fizičku imovinu	RM, MTP, OTP APA CTP	Razmjena instrumenta za fizičku imovinu kako je definirano u članku 1.
	„CANC”	Oznaka za poništenje	RM, MTP, OTP APA CTP	Kada se poništi prethodno objavljena transakcija.

▼ **B**

	Oznaka	Naziv oznake	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Opis
	„AMND”	Oznaka za izmjenu	RM, MTP, OTP APA CTP	Kada se izmijeni prethodno objavljena transakcija.

DODATNE OZNAKE ZA ODGODU OBJAVE

Članak 11. stavak 1. točka (a) podtočka i.	„LMTF”	Oznaka za ograničene pojedinosti	RM, MTP, OTP APA CTP	Prvo izvješće s objavom ograničenih pojedinosti u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (a) podtočkom i.
	„FULF”	Oznaka za potpune pojedinosti		Transakcija za koju su ograničene pojedinosti prethodno objavljene u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (a) podtočkom i.
Članak 11. stavak 1. točka (a) podtočka ii.	„DATF”	Oznaka transakcije u zbirnom obliku po danu	RM, MTP, OTP APA CTP	Objava transakcije u zbirnom obliku po danu u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (a) podtočkom ii.
	„FULA”	Oznaka za potpune pojedinosti	RM, MTP, OTP APA CTP	Pojedinačne transakcije za koje su pojedinosti u zbirnom obliku prethodno objavljene u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (a) podtočkom ii.
Članak 11. stavak 1. točka (b)	„VOLO”	Oznaka za izostavljanje volumena	RM, MTP, OTP APA CTP	Transakcija za koju su ograničene pojedinosti objavljene u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (b).
	„FULV”	Oznaka za potpune pojedinosti	RM, MTP, OTP APA CTP	Transakcija za koju su ograničene pojedinosti prethodno objavljene u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (b).
Članak 11. stavak 1. točka (c)	„FWAF”	Oznaka za objavu u zbirnom obliku za razdoblje od četiri tjedna	RM, MTP, OTP APA CTP	Objava transakcija u zbirnom obliku u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (c).
	„FULJ”	Oznaka za potpune pojedinosti	RM, MTP, OTP APA CTP	Pojedinačne transakcije na koje se prethodno primijenila objava u zbirnom obliku u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (c).
Članak 11. stavak 1. točka (d)	„IDAF”	Oznaka za objavu u zbirnom obliku za neodređeno razdoblje	RM, MTP, OTP APA CTP	Transakcije za koje je objava nekoliko transakcija u zbirnom obliku za neodređeno razdoblje dopuštena u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (d).

▼ B

	Oznaka	Naziv oznake	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Opis
Uzastopna primjena članka 11. stavka 1. točke (b) i članka 11. stavka 2. točke (c) za državne dužničke instrumente	„VOLW”	Oznaka za izostavljanje volumena	RM, MTP, OTP APA CTP	Transakcija za koju su ograničene pojedinosti objavljene u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (b) i za koju će uzastopna objava nekoliko transakcija u zbirnom obliku za neodređeno razdoblje biti dopuštena u skladu s člankom 11. stavkom 2. točkom (c).
	„COAF”	Oznaka za uzastopnu objavu u zbirnom obliku (izostavljanje volumena poslije trgovanja za državne dužničke instrumente)	RM, MTP, OTP APA CTP	Transakcije za koje su ograničene pojedinosti prethodno objavljene u skladu s člankom 11. stavkom 1. točkom (b) i za koje je uzastopna objava nekoliko transakcija u zbirnom obliku za neodređeno razdoblje dopuštena u skladu s člankom 11. stavkom 2. točkom (c).

Tablica 4.

Mjera volumena

Vrsta instrumenta	Volumen
Sve obveznice osim ETC-ova i ETN-ova i strukturirani financijski proizvodi	Ukupna nominalna vrijednost dužničkih instrumenata kojima se trguje
Vrste obveznica – ETC-ovi i ETN-ovi	Broj jedinica kojima se trguje ⁽¹⁾
Sekuritizirane izvedenice	Broj jedinica kojima se trguje ⁽¹⁾
Kamatne izvedenice	Zamišljeni iznos ugovora kojima se trguje
Valutne izvedenice	Zamišljeni iznos ugovora kojima se trguje
Vlasničke izvedenice	Zamišljeni iznos ugovora kojima se trguje
Robne izvedenice	Zamišljeni iznos ugovora kojima se trguje
Kreditne izvedenice	Zamišljeni iznos ugovora kojima se trguje
Ugovori za razlike	Zamišljeni iznos ugovora kojima se trguje
C10 izvedenice	Zamišljeni iznos ugovora kojima se trguje
Izvedenice emisijskih jedinica	Tone ekvivalenta ugljikovog dioksida
Emisijske jedinice	Tone ekvivalenta ugljikovog dioksida

⁽¹⁾ Cijena po jedinici.

*PRILOG III.***Ocjena likvidnosti, pragovi za veliki tržišni obujam (LIS) i veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) za nevlasničke financijske instrumente****1. Upute za potrebe ovog priloga**

1. Upućivanje na „razred imovine” znači upućivanje na sljedeće razrede financijskih instrumenata: obveznice, strukturirane financijske proizvode, sekuritizirane izvedenice, kamatne izvedenice, vlasničke izvedenice, robne izvedenice, valutne izvedenice, kreditne izvedenice, C10 izvedenice, ugovore za razliku (CFD), emisijske jedinice i izvedenice emisijskih jedinica.
2. Upućivanje na „podrazred imovine” znači upućivanje na razred imovine koji je segmentiran na detaljnijoj razini na temelju vrste ugovora i/ili vrste odnosne imovine.
3. Upućivanje na „podrazred” znači upućivanje na podrazred imovine segmentiran na detaljnijoj razini na temelju dodatnih kvalitativnih kriterija segmentacije iz tablica 2.1. do 13.3. iz ovog Priloga.
4. „Prosječni dnevni promet (ADT)” znači ukupni promet za određeni financijski instrument, utvrđen u skladu s mjerom volumena iz tablice 4. Priloga II. i izvršen u razdoblju iz članka 13. stavka 7., podijeljeno s brojem dana trgovanja u tom razdoblju ili, ako je primjenjivo, onom dijelu godine u kojemu je financijski instrument bio uvršten za trgovanje ili se njime trgovalo na mjestu trgovanja i nije bio suspendiran iz trgovanja.
5. „Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)” znači ukupni zamišljeni iznos za određeni financijski instrument utvrđen u skladu s mjerom volumena iz tablice 4. Priloga II. i izvršen u razdoblju utvrđenom u članku 13. stavku 18. za sve obveznice osim za robu kojom se trguje na burzi i dužničke instrumente kojima se trguje na burzi te u članku 13. stavku 7. za sve druge financijske instrumente, podijeljen s brojem dana trgovanja u tom razdoblju ili, ako je primjenjivo, onom dijelu godine u kojemu je financijski instrument bio uvršten za trgovanje ili se njime trgovalo na mjestu trgovanja i nije bio suspendiran iz trgovanja.
6. „Postotak dana trgovanja za vrijeme razmatranog razdoblja” znači broj dana u razdoblju utvrđenom u članku 13. stavku 18. za sve obveznice osim za robu kojom se trguje na burzi i dužničke instrumente kojima se trguje na burzi i u članku 13. stavku 7. za strukturirane financijske proizvode, na koje je izvršena barem jedna transakcija za taj financijski instrument, podijeljeno s brojem dana trgovanja u tom razdoblju, ili, ako je primjenjivo, onom dijelu godine u kojemu je financijski instrument bio uvršten za trgovanje ili se njime trgovalo na mjestu trgovanja i nije bio suspendiran iz trgovanja.
7. „Prosječni dnevni broj transakcija” znači ukupni broj transakcija izvršen za određeni financijski instrument u razdoblju utvrđenom u članku 13. stavku 18. za sve obveznice osim za robu kojom se trguje na burzi i dužničke instrumente kojima se trguje na burzi te u članku 13. stavku 7. za sve druge financijske instrumente, podijeljen s brojem dana trgovanja u tom razdoblju ili, ako je primjenjivo, onom dijelu godine u kojemu je financijski instrument bio uvršten za trgovanje ili se njime trgovalo na mjestu trgovanja i nije bio suspendiran iz trgovanja.

▼ B

8. „Budućnosnica” znači ugovor o kupnji ili prodaji robe ili financijskog instrumenta na određeni budući datum po cijeni dogovorenoj pri sklapanju ugovora između kupca i prodavatelja. Svaka budućnosnica ima standardne odredbe kojima se utvrđuju minimalna količina i kvaliteta koja se može kupiti ili prodati, najmanji iznos za koji se može promijeniti cijena, postupke za isporuku, datum dospeljeća i ostala obilježja u vezi s ugovorom.
9. „Opcija” znači ugovor kojim vlasnik stječe pravo, ali ne i obvezu, kupnje (*call*) ili prodaje (*put*) određenog financijskog instrumenta ili robe po unaprijed utvrđenoj cijeni, izvršnoj cijeni ili cijeni izvršenja, na određeni budući datum ili datum izvršenja ili do tog datuma.
10. „Ugovor o razmjeni” znači ugovor kojim se dvije strane dogovaraju da će na određeni budući datum razmijeniti novčane tokove iz jednog financijskog instrumenta s novčanim tokovima iz drugog financijskog instrumenta.
11. „Ugovor o razmjeni na razini portfelja” znači ugovor na temelju kojeg krajnji korisnici mogu trgovati s većim brojem ugovora o razmjeni.
12. „Terminski ugovor” znači privatni dogovor između dvije strane o kupnji ili prodaji robe ili financijskog instrumenta na određeni budući datum po cijeni dogovorenoj pri sklapanju ugovora između kupca i prodavatelja.

▼ M3

13. „Opcija razmjene” ili „opcija koja se odnosi na ugovor o razmjeni” znači ugovor o opciji kojim vlasnik stječe pravo, ali ne i obvezu, sklapanja ugovora o razmjeni na određeni budući datum ili do tog datuma.

▼ B

14. „Budućnosnica koja se odnosi na ugovor o razmjeni” znači budućnosnica kojom vlasnik stječe obvezu sklopiti ugovor o razmjeni na određeni budući datum ili do tog datuma.
15. „Terminski ugovor koji se odnosi na ugovor o razmjeni” znači terminski ugovor kojim vlasnik stječe obvezu sklopiti ugovor o razmjeni na određeni budući datum ili do tog datuma.

2. Obveznice*Tablica 2.1.*

Obveznice (sve vrste obveznica osim robe kojom se trguje na burzi (ETC) i dužničkih instrumenata kojima se trguje na burzi (ETN)) – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – obveznice (sve vrste obveznica osim robe kojom se trguje na burzi (ETC) i dužničkih instrumenata kojima se trguje na burzi (ETN))					
Za svaki se pojedini financijski instrument utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti na kumulativnoj osnovi ili sve njih					
Prosječni dnevni zamišljeni iznos [kvantitativni kriterij likvidnosti br. 1.]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti br. 2.]				Postotak dana trgovanja tijekom razmatranog razdoblja [kvantitativni kriterij likvidnosti br. 3.]
100 000 EUR	S1	S2	S3	S4	80 %
	15	10	7	2	

Tablica 2.2.

Obveznice (sve vrste obveznica osim ETC-a i ETN-a) – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – obveznice (sve vrste obveznica osim ETC-a i ETN-a)			
Za svaku se pojedinu obveznicu utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 13. stavkom 18. ako joj je obilježje posebna kombinacija vrste obveznice i veličina izdanja kako je navedeno u svakom retku tablice.			
Vrsta obveznice		Veličina izdanja – RTS23#14	
Državna obveznica RTS2#3 = BOND i RTS2#9 = EUSB	znači obveznica koja nije ni konvertibilna niti pokrivena koju je izdao državni izdavatelj: (a) Unija; (b) država članica uključujući ministarstvo, agenciju ili subjekt posebne namjene države članice; (c) državni subjekt koji nije naveden u točkama (a) i (b).	manje od (u EUR)	1 000 000 000
Druge obveznice javnog sektora RTS2#3 = BOND i RTS2#9 = OEPB	znači obveznica koja nije ni konvertibilna niti pokrivena koju je izdao jedan od sljedećih izdavatelja iz javnog sektora: (a) u slučaju federalne države članice, član te federacije; (b) subjekt posebne namjene za nekoliko država članica; (c) međunarodna financijska institucija koju su osnovala dvije ili više država članica, čija je svrha mobilizirati sredstva i pružiti financijsku pomoć u korist svojih članova koji imaju ili im prijete ozbiljne financijske poteškoće; (d) Europska investicijska banka; (e) javni subjekt koji nije izdavatelj državne obveznice iz prethodnog retka.	manje od (u EUR)	500 000 000

Razred imovine – obveznice (sve vrste obveznica osim ETC-a i ETN-a)			
Vrsta obveznice		Veličina izdanja – RTS23#14	
Konvertibilna obveznica RTS2#3 = BOND i RTS2#9 = CVTB	znači instrument koji se sastoji od obveznice ili sekuritiziranog dužničkog instrumenta s ugrađenom izvedenicom, npr. opcija kupnje odnosno vlasničkog instrumenta.	manje od (u EUR)	500 000 000
Pokrivena obveznica RTS2#3 = BOND i RTS2#9 = CVDB	znači obveznice iz članka 52. stavka 4. Direktive 2009/65/EZ	za vrijeme faza S1 i S2	
		manje od (u EUR)	1 000 000 000
Korporativna obveznica RTS2#3 = BOND i RTS2#9 = CRPB	znači obveznica koja nije ni konvertibilna niti pokrivena koju je izdalo europsko društvo (Societas Europaea) osnovano u skladu s Uredbom Vijeća (EZ) br. 2157/2001 ⁽¹⁾ ili vrsta društva navedenog u Prilogu I. ili Prilogu II. Direktivi 2013/34/EU Europskog parlamenta i Vijeća ⁽²⁾ ili ekvivalentno društvo u trećim zemljama	za vrijeme faza S3 i S4	
		manje od (u EUR)	500 000 000
Vrsta obveznice	Za potrebe utvrđivanja financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 13. stavkom 18. primjenjuje se sljedeća metodologija		
Druga obveznica RTS2#3 = BOND i RTS2#9 = OTHR	Smatra se da za obveznicu koja ne pripada ni jednoj od prethodno navedenih vrsta obveznica ne postoji likvidno tržište.		

⁽¹⁾ Uredba Vijeća (EZ) br. 2157/2001 od 8. listopada 2001. o Statutu europskog društva (SE) (SL L 294, 10.11.2001., str. 1.).

⁽²⁾ Direktiva 2013/34/EU Europskog parlamenta i Vijeća od 26. lipnja 2013. o godišnjim financijskim izvještajima, konsolidiranim financijskim izvještajima i povezanim izvješćima za određene vrste poduzeća, o izmjeni Direktive 2006/43/EZ Europskog parlamenta i Vijeća i o stavljanju izvan snage direktiva Vijeća 78/660/EEZ i 83/349/EEZ (SL L 182, 29.6.2013., str. 19.).

Tablica 2.3.

Obveznice (sve vrste obveznica osim robe kojom se trguje na burzi i dužničkih instrumenata kojima se trguje na burzi) – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja

Razred imovine – obveznice (sve vrste obveznica osim robe kojom se trguje na burzi (ETC) i dužničkih instrumenata kojima se trguje na burzi (ETN))										
Vrsta obveznice	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova po vrsti obveznice	Percentili koje treba primijeniti za izračun pragova za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za sve vrste obveznica								
		SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja	
		Trgovanje – percentil		donji prag		Trgovanje – percentil	donji prag	Trgovanje – percentil	Trgovanje – percentil	
Državna obveznica	transakcije izvršene s državnim obveznicama nakon izuzimanja transakcija kako je utvrđeno u članku 13. stavku 10.	S1	S2	S3	S4	300 000 EUR	70	300 000 EUR	80	90
		30	40	50	60					
Druga javna obveznica	transakcije izvršene s drugim javnim obveznicama nakon izuzimanja transakcija kako je utvrđeno u članku 13. stavku 10.	S1	S2	S3	S4	300 000 EUR	70	300 000 EUR	80	90
		30	40	50	60					
Konvertibilna obveznica	transakcije izvršene s konvertibilnim obveznicama nakon izuzimanja transakcija kako je utvrđeno u članku 13. stavku 10.	S1	S2	S3	S4	200 000 EUR	70	200 000 EUR	80	90
		30	40	50	60					
Pokrivena obveznica	transakcije izvršene s pokrivenim obveznicama nakon izuzimanja transakcija kako je utvrđeno u članku 13. stavku 10.	S1	S2	S3	S4	300 000 EUR	70	300 000 EUR	80	90
		30	40	40	40					
Korporativna obveznica	transakcije izvršene s korporativnim obveznicama nakon izuzimanja transakcija kako je utvrđeno u članku 13. stavku 10.	S1	S2	S3	S4	200 000 EUR	70	200 000 EUR	80	90
		30	40	50	60					
Druge obveznice	transakcije izvršene s drugim obveznicama nakon izuzimanja transakcija kako je utvrđeno u članku 13. stavku 10.	S1	S2	S3	S4	200 000 EUR	70	200 000 EUR	80	90
		30	40	50	60					

▼ M3

Tablica 2.4.

Obveznice (vrsta obveznica ETC i ETN) – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Vrsta obveznice	Za svaki se pojedini financijski instrument utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
	Prosječni dnevni promet (ADT) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Roba kojom se trguje na burzi (ETC) – RTS2#3 = ETCS dužnički instrument koji se izdaje za izravno ulaganje izdavatelja u robu ili ugovore o robnim izvedenicama. Cijena robe kojom se trguje na burzi izravno je ili neizravno povezana s rezultatom odnosnog instrumenta. Roba kojom se trguje na burzi pasivno replicira rezultat robe ili indeksa robe na koji se odnosi.	500 000 EUR	10
Dužnički instrumenti kojima se trguje na burzi (ETN) – RTS2#3 = ETNS dužnički instrument koji se izdaje za izravno ulaganje izdavatelja u odnosni instrument ili odnosne ugovore o izvedenicama. Cijena ETN-a izravno je ili neizravno povezana s rezultatom odnosnog instrumenta. ETN pasivno replicira rezultat odnosnog instrumenta na koji se odnosi.	500 000 EUR	10

▼ B

Tablica 2.5.

Obveznice (vrsta obveznice – roba kojom se trguje na burzi (ETC) i dužnički instrumenti kojima se trguje na burzi (ETN)) – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja

Razred imovine – obveznice (vrste obveznica – roba kojom se trguje na burzi (ETC) i dužnički instrumenti kojima se trguje na burzi (ETN))				
Pragovi za veličinu karakterističnu za financijski instrument (SSTI) i veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za svaki pojedini instrument za koji je utvrđeno da postoji likvidno tržište				
Vrsta obveznice	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
ETC	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR	50 000 000 EUR	50 000 000 EUR
ETN	1 000 000 EUR	1 000 000 EUR	50 000 000 EUR	50 000 000 EUR

▼B

Razred imovine – obveznice (vrste obveznica – roba kojom se trguje na burzi (ETC) i dužnički instrumenti kojima se trguje na burzi (ETN))				
Pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za svaki pojedini instrument za koji je utvrđeno da ne postoji likvidno tržište				
Vrsta obveznice	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
ETC	900 000 EUR	900 000 EUR	45 000 000 EUR	45 000 000 EUR
ETN	900 000 EUR	900 000 EUR	45 000 000 EUR	45 000 000 EUR

3. Strukturirani financijski proizvodi (SFP)

▼M3

Tablica 3.1.

Strukturirani financijski proizvodi (SFP) – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – strukturirani financijski proizvodi (SFP)		
Test 1 – procjena razreda imovine strukturirani financijski proizvodi		
Procjena razreda imovine strukturirani financijski proizvodi za potrebe utvrđivanja financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) – RTS2#3 = SFPS		
Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune vrijednosti koje se odnose na kvantitativne kriterije likvidnosti za potrebe procjene razreda imovine strukturirani financijski proizvodi	Razred imovine strukturirani financijski proizvodi procjenjuje se primjenom sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
	Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Transakcije izvršene sa svim strukturiranim financijskim proizvodima	300 000 000 EUR	500
Test 2 – strukturirani financijski proizvodi (SFP) za koje ne postoji likvidno tržište		
Ako su vrijednosti koje se odnose na kvantitativne kriterije likvidnosti veće od pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti utvrđenih za potrebe procjene razreda imovine strukturirani financijski proizvodi, test 1 je uspješno proveden i provodi se test 2. Za svaki se pojedini financijski instrument utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti		
Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Postotak dana trgovanja tijekom razmatranog razdoblja [kvantitativni kriterij likvidnosti 3]
100 000 EUR	2	80 %

Tablica 3.2.

Strukturirani financijski proizvodi (SFP) – pragovi za veličinu karakterističnu za financijski instrument (SSTI) i veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja ako test 1 nije uspješno proveden

Razred imovine – strukturirani financijski proizvodi (SFP)			
Pragovi za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za sve strukturirane financijske proizvode (SFP) ako test 1 nije uspješno proveden			
SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
100 000 EUR	250 000 EUR	500 000 EUR	1 000 000 EUR

Tablica 3.3.

Strukturirani financijski proizvodi (SFP) – pragovi za veličinu karakterističnu za financijski instrument (SSTI) i veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja ako je test 1 uspješno proveden

Razred imovine – strukturirani financijski proizvodi (SFP)											
Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova	Percentili i donji pragovi koje treba primijeniti za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za strukturirane financijske proizvode za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji ako je test 1 uspješno proveden										
	SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja		LIS poslije trgovanja		
	Trgovanje – percentil		Donji prag		Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	
Transakcije izvršene sa svim strukturiranim financijskim proizvodima za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji	S1	S2	S3	S4	100 000 EUR	70	250 000 EUR	80	500 000 EUR	90	1 000 000 EUR
	30	40	50	60							

Pragovi za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za strukturirane financijske proizvode za koje je utvrđeno da likvidno tržište ne postoji ako je test 1 uspješno proveden			
SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
100 000 EUR	250 000 EUR	500 000 EUR	1 000 000 EUR

▼ **B**

4. **Sekuritizirane izvedenice**

▼ **M3**

Tablica 4.1.

Sekuritizirane izvedenice – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – sekuritizirane izvedenice

To su prenosivi vrijednosni papiri kako su definirani u članku 4. stavku 1. točki 44. podtočki (c) Direktive 2014/65/EU koji se razlikuju od strukturiranih financijskih proizvoda i uključuju najmanje sljedeće:

- (a.1) standardne (*plain vanilla*) pokrivene varante, a to su vrijednosni papiri koje izdaje financijska institucija i kojima vlasnik stječe pravo, ali ne i obvezu,
 - (a) da na datum isteka ili do tog datuma kupi određenu količinu odnosno imovine po unaprijed utvrđenoj izvršnoj cijeni ili, ako je utvrđena namira u novcu, pravo da od prodavatelja primi isplatu pozitivne razlike između trenutačne tržišne cijene i izvršne cijene ili
 - (b) da na datum isteka ili do tog datuma proda određenu količinu odnosno imovine po unaprijed utvrđenoj izvršnoj cijeni ili, ako je utvrđena namira u novcu, pravo da od kupca primi isplatu pozitivne razlike između izvršne cijene i trenutačne tržišne cijene;
- (a.2) varante, a to su vrijednosni papiri koje izdaje izdavatelj odnosno imovine kojima vlasnik stječe pravo, ali ne i obvezu,
 - (a) da na datum isteka ili do tog datuma kupi određenu količinu odnosno imovine po unaprijed utvrđenoj izvršnoj cijeni ili, ako je utvrđena namira u novcu, pravo da od prodavatelja primi isplatu pozitivne razlike između trenutačne tržišne cijene i izvršne cijene ili
 - (b) da na datum isteka ili do tog datuma proda određenu količinu odnosno imovine po unaprijed utvrđenoj izvršnoj cijeni ili, ako je utvrđena namira u novcu, pravo da od kupca primi isplatu pozitivne razlike između izvršne cijene i trenutačne tržišne cijene;
- (b) certifikate s financijskom polugom, a to su certifikati kojima se replicira rezultat odnosno imovine s učinkom poluge;
- (c) egzotične pokrivene varante, a to su pokriveni varanti čija je osnovna komponenta kombinacija opcija;
- (d) prenosiva prava čija je odnosna imovina ne vlasnički instrument;
- (e) certifikate s ulaganjima, a to su certifikati kojima se replicira rezultat odnosno imovine bez učinka poluge.

RTS2#3 = SDRV

Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija

Smatra se da za sve sekuritizirane izvedenice postoji likvidno tržište.

▼B

Tablica 4.2.

Sekuritizirane izvedenice – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja

Razred imovine – sekuritizirane izvedenice			
Pragovi za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja			
SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
50 000 EUR	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

5. Kamatne izvedenice

▼M3

Tablica 5.1.

Kamatne izvedenice – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – kamatne izvedenice			
-------------------------------------	--	--	--

Svaki ugovor kako je definiran u odjeljku C točki 4. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU u kojem je krajnji odnosni instrument kamatna stopa, obveznica, kredit, bilo koja košarica, portfelj ili indeks koji uključuje kamatnu stopu, obveznicu, kredit ili svaki drugi proizvod koji predstavlja rezultat kamatne stope, obveznice ili kredita.

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
Obvezničke budućnosnice / terminski ugovori koji se odnose na obveznice / Budućnosnica na obvezničku budućnosnicu	Podrazred obveznička budućnosnica / terminski ugovor koji se odnosi na obveznice definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije 1 (RTS2#17) – izdavatelj odnosnog instrumenta Kriterij segmentacije 2 (RTS2#18) – trajanje odnosne obveznice s isporukom definira se kako slijedi:	5 000 000 EUR	10	Svaki put kad se utvrdi da za podrazred postoji likvidno tržište s obzirom na određeno vrijeme do razreda dospijea, a za podrazred definiran sljedećim vremenom do razdoblja dospijea

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
<p>/ Terminski ugovor o obvezničkoj budućnosnici</p> <p>Obveznička budućnosnica</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = FUTR</p> <p>RTS2#16 = BOND</p> <p>ili</p> <p>terminski ugovor koji se odnosi na obveznicu</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = FORW</p> <p>RTS2#16 = BOND</p> <p>ili</p> <p>Budućnosnica na obvezničku budućnosnicu</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p>	<p>kratkoročna: odnosna obveznica s isporukom trajanja do 4 godine smatra se kratkoročnom</p> <p>srednjoročna: odnosna obveznica s isporukom trajanja od 4 do 8 godina smatra se srednjoročnom</p> <p>dugoročna: odnosna obveznica s isporukom trajanja od 8 do 15 godina smatra se dugoročnom</p> <p>vrlo dugoročna: odnosna obveznica s isporukom trajanja duljeg od 15 godina smatra se vrlo dugoročnom</p> <p>Kriterij segmentacije 3 – vrijeme do razreda dospijea budućnosnice definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijea 1: $0 < \text{vrijeme do dospijea} \leq 3$ mjeseca</p> <p>Razred dospijea 2: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 6$ mjeseci</p> <p>Razred dospijea 3: $6 \text{ mjeseci} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospijea 4: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 2$ godine</p> <p>Razred dospijea 5: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 3$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijea m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq n$ godina</p>			<p>utvrdi da ne postoji likvidno tržište, utvrđuje se da za prvi ugovor s najduljim dospijecom (<i>back month contract</i>) likvidno tržište postoji dva tjedna prije isteka ugovora s najkraćim dospijecom (<i>front month contract</i>)</p>

▼ M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti. Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
RTS2#5 = FUTR RTS2#16 = BNFD ili Terminski ugovor o obvezničkoj budućnosnici RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FORW RTS2#16 = BNFD				
Obveznička opcija / Opcija na obvezničku opciju / Opcija na obvezničku budućnosnicu Obveznička opcija Opcija na obvezničku opciju RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR	Podrazred obveznička opcija definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije 1 (RTS2#22) – krajnja odnosna obveznica Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijea opcije definirano je kako slijedi: Razred dospijea 1: $0 < \text{vrijeme do dospijea} \leq 3$ mjeseca Razred dospijea 2: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 6$ mjeseci Razred dospijea 3: $6 \text{ mjeseci} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 1$ godina Razred dospijea 4: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 2$ godine Razred dospijea 5: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 3$ godine ... Razred dospijea m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq n$ godina	5 000 000 EUR	10	

▼ M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
RTS2#5 = OPTN				
RTS2#16 = BOND				
ili				
Opcija na obvezničku opciju				
RTS2#3 = DERV				
RTS2#4 = INTR				
RTS2#5 = OPTN				
RTS2#16 = BOND				
ili				
Opcija na obvezničku budućno-snicu				
RTS2#3 = DERV				
RTS2#4 = INTR				
RTS2#5 = OPTN				
RTS2#16 = BNFD				

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti. Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
Kamatne budućnosnice i kamatni terminski ugovori / budućnosnica na kamatnu budućnosnicu / kamatni terminski ugovor na kamatnu budućnosnicu Kamatna budućnosnica RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FUTR RTS2#16 = INTR ili Terminski ugovor o kamatnoj stopi RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FRAS RTS2#16 = INTR ili budućnosnica na kamatnu budućnosnicu	Podrazred kamatna budućnosnica definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije 1 (RTS2#24) – odnosna kamatna stopa Kriterij segmentacije 2 (RTS2#25) – rok odnosno kamatne stope Kriterij segmentacije 3 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijea budućnosnice definirano je kako slijedi: Razred dospijea 1: $0 < \text{vrijeme do dospijea} \leq 3$ mjeseca Razred dospijea 2: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 6$ mjeseci Razred dospijea 3: $6 \text{ mjeseci} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 1$ godina Razred dospijea 4: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 2$ godine Razred dospijea 5: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 3$ godine ... Razred dospijea m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq n$ godina	500 000 000 EUR	10	Svaki put kad se utvrdi da za podrazred postoji likvidno tržište s obzirom na određeno vrijeme do razreda dospijea, a za podrazred definiran sljedećim vremenom do razreda dospijea utvrdi da ne postoji likvidno tržište, za prvi ugovor s najduljim dospijecom (<i>back month contract</i>) utvrđuje se da postoji likvidno tržište dva tjedna prije isteka ugovora s najkraćim dospijecom (<i>front month contract</i>)

▼ M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FUTR RTS2#16 = IFUT ili kamatni terminski ugovor na kamatnu budućnosnicu RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FRAS RTS2#16 = IFUT				
Kamatne opcije / Opcija na kamatnu budućnosnicu/FRA / Opcija na kamatnu opciju	podrazred kamatna opcija definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije 1 (RTS2#24) – odnosna kamatna stopa Kriterij segmentacije 2 (RTS2#25) – rok odnosne kamatne stope Kriterij segmentacije 3 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća opcije definirano je kako slijedi: Razred dospijeća 1: $0 < \text{vrijeme do dospijeća} \leq 3$ mjeseca	500 000 000 EUR	10	

▼ M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
<p>/ Opcija na opciju na kamatnu budućnosnicu/FRA</p> <p>Opcija na kamatnu budućnosnicu/FRA/opcija na kamatnu opciju</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#16 = IFUT</p> <p>ili</p> <p>Kamatna opcija // opcija na opciju na kamatnu budućnosnicu/FRA</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#16 = INTR</p>	<p>Razred dospijeća 2: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci</p> <p>Razred dospijeća 3: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina</p> <p>Razred dospijeća 4: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine</p> <p>Razred dospijeća 5: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina</p>			

▼ M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
<p>Opcije razmjene</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWPT</p>	<p>Podrazred opcija razmjene definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS2#16) – vrsta odnosnog ugovora o razmjeni definirana je kako slijedi: jednovalutni ugovor o razmjeni fiksne za fiksnu kamatnu stopu, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na jednovalutni ugovor o razmjeni fiksne za fiksnu kamatnu stopu [RTS2#16 = XXSC]</p> <p>jednovalutni ugovor o razmjeni fiksne za promjenjivu kamatnu stopu, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na jednovalutni ugovor o razmjeni fiksne za promjenjivu kamatnu stopu [RTS2#16 = XFSC]</p> <p>jednovalutni ugovor o razmjeni promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na jednovalutni ugovor o razmjeni promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu [RTS2#16 = FFSC]</p> <p>inflacijski jednovalutni ugovor o razmjeni, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na inflacijski jednovalutni ugovor o razmjeni [RTS2#16 = IFSC]</p> <p>prekonoćni kamatni jednovalutni ugovor o razmjeni, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na prekonoćni kamatni jednovalutni ugovor o razmjeni [RTS2#16 = OSSC]</p> <p>viševalutni ugovor o razmjeni fiksne za fiksnu kamatnu stopu, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na viševalutni ugovor o razmjeni fiksne za fiksnu kamatnu stopu [RTS2#16 = XXMC]</p>	500 000 000 EUR	10	

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
	<p>viševalutni ugovor o razmjeni fiksne za promjenjivu kamatnu stopu, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na viševalutni ugovor o razmjeni fiksne za promjenjivu kamatnu stopu [RTS2#16 = XFMC]</p> <p>viševalutni ugovor o razmjeni promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na viševalutni ugovor o razmjeni promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu [RTS2#16 = FFMC]</p> <p>inflacijski viševalutni ugovor o razmjeni, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na inflacijski viševalutni ugovor o razmjeni [RTS2#16 = IFMC]</p> <p>prekonoćni viševalutni ugovor o razmjeni, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na prekonoćni viševalutni ugovor o razmjeni [RTS2#16 = OSMC]</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#20) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa opcije</p> <p>Kriterij segmentacije 3 (RTS2#22 ili RTS2#23) – inflacijski indeks ako je odnosni ugovor o razmjeni inflacijski jednovalutni ili inflacijski viševalutni ugovor o razmjeni</p> <p>Kriterij segmentacije 4 (RTS2#21) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijeća 1: $0 < \text{vrijeme do dospijeća} \leq 1$ mjesec</p> <p>Razred dospijeća 2: $1 \text{ mjesec} < \text{vrijeme do dospijeća} \leq 3$ mjeseca</p>			

▼ M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
	<p>Razred dospijeća 3: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci</p> <p>Razred dospijeća 4: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina</p> <p>Razred dospijeća 5: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine</p> <p>Razred dospijeća 6: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina</p> <p>Kriterij segmentacije 5 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća opcije definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci</p> <p>Razred dospijeća 2: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina</p> <p>Razred dospijeća 3: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine</p> <p>Razred dospijeća 4: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 5 godine</p> <p>Razred dospijeća 5: 5 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 10 godine</p> <p>Razred dospijeća 6: dulje od 10 godina</p>			

▼ M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
<p>„Viševalutni ili međuvalutni ugovori o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori/opcije koji se odnose na „viševalutne ili međuvalutne ugovore o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu</p> <p>ugovor o razmjeni ili budućnosnica/terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u istoj valuti i novčani tokovi jedne platne strane utvrđeni su s fiksnom kamatnom stopom, dok su novčani tokovi druge platne strane utvrđeni s promjenjivom kamatnom stopom.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS</p> <p>RTS2#16 = XFMC</p>	<p>podrazred viševalutni ugovor o razmjeni fiksne za promjenjivu kamatnu stopu definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS23#13 i RTS23#42) – valutni par zamišljenog iznosa definiran je kao kombinacija dviju valuta u kojima su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeca ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijeca 1: $0 < \text{dospijeće} \leq 1$ mjesec</p> <p>Razred dospijeca 2: $1 \text{ mjesec} < \text{dospijeće} \leq 3$ mjeseca</p> <p>Razred dospijeca 3: $3 \text{ mjeseca} < \text{dospijeće} \leq 6$ mjeseci</p> <p>Razred dospijeca 4: $6 \text{ mjeseci} < \text{dospijeće} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospijeca 5: $1 \text{ godina} < \text{dospijeće} \leq 2$ godine</p> <p>Razred dospijeca 6: $2 \text{ godine} < \text{dospijeće} \leq 3$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijeca m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq n$ godina</p>	50 000 000 EUR	10	

▼ M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
<p>„Viševalutni ili međuvalutni ugovori o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori/opcije koji se odnose na „viševalutne ili međuvalutne ugovore o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu</p> <p>ugovor o razmjeni ili budućnosnica/terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u različitim valutama i u kojem su novčani tokovi obje platne strane utvrđeni s promjenjivim kamatnim stopama</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS</p> <p>RTS2#16 = FFMC</p>	<p>podrazred viševalutni ugovor o razmjeni promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS23#13 i RTS23#42) –valutni par zamišljenog iznosa definiran je kao kombinacija dviju valuta u kojima su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospjeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospjeća 1: $0 < \text{dospijeće} \leq 1$ mjesec</p> <p>Razred dospjeća 2: $1 \text{ mjesec} < \text{dospijeće} \leq 3$ mjeseca</p> <p>Razred dospjeća 3: $3 \text{ mjeseca} < \text{dospijeće} \leq 6$ mjeseci</p> <p>Razred dospjeća 4: $6 \text{ mjeseci} < \text{dospijeće} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospjeća 5: $1 \text{ godina} < \text{dospijeće} \leq 2$ godine</p> <p>Razred dospjeća 6: $2 \text{ godine} < \text{dospijeće} \leq 3$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospjeća m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq n$ godina</p>	50 000 000 EUR	10	

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
<p>„Viševalutni ili međuvalutni ugovori o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori/opcije koji se odnose na „viševalutne ili međuvalutne ugovore o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu</p> <p>ugovor o razmjeni ili budućnosnica/terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u različitim valutama i u kojem su novčani tokovi obje platne strane utvrđeni s fiksnim kamatnim stopama</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS</p> <p>RTS2#16 = XXMC</p>	<p>podrazred viševalutni ugovor o razmjeni fiksne za fiksnu kamatnu stopu definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS23#13 i RTS23#42) –valutni par zamišljenog iznosa definiran je kao kombinacija dviju valuta u kojima su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospjeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospjeća 1: $0 < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 1$ mjesec</p> <p>Razred dospjeća 2: $1 \text{ mjesec} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 3$ mjeseca</p> <p>Razred dospjeća 3: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 6$ mjeseci</p> <p>Razred dospjeća 4: $6 \text{ mjeseci} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospjeća 5: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 2$ godine</p> <p>Razred dospjeća 6: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 3$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospjeća m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq n$ godina</p>	50 000 000 EUR	10	

▼ M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
<p>Prekonoćni kamatni „viševalutni ili međuvalutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice/terminski ugovori/ opcije koji se odnose na prekonoćne kamatne „viševalutne ili međuvalutne ugovore o razmjeni”</p> <p>ugovor o razmjeni ili budućnosnica/ terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u različitim valutama i u kojem su novčani tokovi barem jedne strane utvrđeni s prekonoćnom indeksiranom kamatnom stopom</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS</p> <p>RTS2#16 = OSMC</p>	<p>podrazred prekonoćni kamatni viševalutni ugovor o razmjeni definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS23#13 i RTS23#42) –valutni par zamišljenog iznosa definiran je kao kombinacija dviju valuta u kojima su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospjeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospjeća 1: $0 < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 1 \text{ mjesec}$</p> <p>Razred dospjeća 2: $1 \text{ mjesec} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 3 \text{ mjeseca}$</p> <p>Razred dospjeća 3: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 6 \text{ mjeseci}$</p> <p>Razred dospjeća 4: $6 \text{ mjeseci} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 1 \text{ godina}$</p> <p>Razred dospjeća 5: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 2 \text{ godine}$</p> <p>Razred dospjeća 6: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 3 \text{ godine}$</p> <p>...</p> <p>Razred dospjeća m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq n \text{ godina}$</p>	50 000 000 EUR	10	

▼ M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
<p>Inflacijski „viševalutni ili međuvalutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice/terminski ugovori/opcije koji se odnose na inflacijske „viševalutne ili međuvalutne ugovore o razmjeni”</p> <p>ugovor o razmjeni ili budućnosnica/terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u različitim valutama i u kojem su novčani tokovi barem jedne platne strane utvrđeni sa stopom inflacije</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS</p> <p>RTS2#16 = IFMC</p>	<p>podrazred inflacijski viševalutni ugovor o razmjeni definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS23#13 i RTS23#42) –valutni par zamišljenog iznosa definiran je kao kombinacija dviju valuta u kojima su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospjeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospjeća 1: $0 < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 1$ mjesec</p> <p>Razred dospjeća 2: $1 \text{ mjesec} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 3$ mjeseca</p> <p>Razred dospjeća 3: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 6$ mjeseci</p> <p>Razred dospjeća 4: $6 \text{ mjeseci} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospjeća 5: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 2$ godine</p> <p>Razred dospjeća 6: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 3$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospjeća m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq n$ godina</p>	50 000 000 EUR	10	

▼ M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
<p>„Jednovalutni ugovori o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori/opcije koji se odnose na „jednovalutne ugovore o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu</p> <p>ugovor o razmjeni ili budućnosnica/terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u istoj valuti i novčani tokovi jedne platne strane utvrđeni su s fiksnom kamatnom stopom, dok su novčani tokovi druge platne strane utvrđeni s promjenjivom kamatnom stopom</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS</p> <p>RTS2#16 = XFSC</p>	<p>podrazred jednovalutni ugovor o razmjeni fiksne za promjenjivu kamatnu stopu definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS2#13) – valuta zamišljenog iznosa u kojoj su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijea ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijea 1: $0 < \text{vrijeme do dospijea} \leq 1$ mjesec</p> <p>Razred dospijea 2: $1 \text{ mjesec} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 3$ mjeseca</p> <p>Razred dospijea 3: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 6$ mjeseci</p> <p>Razred dospijea 4: $6 \text{ mjeseci} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospijea 5: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 2$ godine</p> <p>Razred dospijea 6: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 3$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijea m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq n$ godina</p>	50 000 000 EUR	10	

▼ M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
<p>„Jednovalutni ugovori o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori/opcije koji se odnose na „jednovalutne ugovore o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu</p> <p>ugovor o razmjeni ili budućnosnica/terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u istoj valuti i u kojem su novčani tokovi obje platne strane utvrđeni s promjenjivim kamatnim stopama</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS</p> <p>RTS2#16 = FFSC</p>	<p>podrazred jednovalutni ugovor o razmjeni promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS2#13) – valuta zamišljenog iznosa u kojoj su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeca ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijeca 1: $0 < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 1 \text{ mjesec}$</p> <p>Razred dospijeca 2: $1 \text{ mjesec} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 3 \text{ mjeseca}$</p> <p>Razred dospijeca 3: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 6 \text{ mjeseci}$</p> <p>Razred dospijeca 4: $6 \text{ mjeseci} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 1 \text{ godina}$</p> <p>Razred dospijeca 5: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 2 \text{ godine}$</p> <p>Razred dospijeca 6: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 3 \text{ godine}$</p> <p>...</p> <p>Razred dospijeca m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq n \text{ godina}$</p>	50 000 000 EUR	10	

▼ M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
<p>„Jednovalutni ugovori o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori/ opcije koji se odnose na „jednovalutne ugovore o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu</p> <p>ugovor o razmjeni ili budućnosnica/ terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u istoj valuti i u kojem su novčani tokovi obje platne strane utvrđeni s fiksnim kamatnim stopama</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS</p> <p>RTS2#16 = XXSC</p>	<p>podrazred jednovalutni ugovor o razmjeni fiksne za fiksnu kamatnu stopu definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS2#13) – valuta zamišljenog iznosa u kojoj su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijea ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijea 1: $0 < \text{vrijeme do dospijea} \leq 1$ mjesec</p> <p>Razred dospijea 2: $1 \text{ mjesec} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 3$ mjeseca</p> <p>Razred dospijea 3: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 6$ mjeseci</p> <p>Razred dospijea 4: $6 \text{ mjeseci} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospijea 5: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 2$ godine</p> <p>Razred dospijea 6: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 3$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijea m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq n$ godina</p>	50 000 000 EUR	10	

▼ M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
<p>Prekonoćni kamatni jednovalutni ugovori o razmjeni i budućnosnice/terminski ugovori/opcije koji se odnose na prekonoćne kamatne jednovalutne ugovore o razmjeni</p> <p>ugovor o razmjeni ili budućnosnica/terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u istoj valuti i u kojem su novčani tokovi barem jedne strane utvrđeni s prekonoćnom indeksiranom kamatnom stopom</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS</p> <p>RTS2#16 = OSSC</p>	<p>podrazred prekonoćni kamatni jednovalutni ugovor o razmjeni definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS2#13) – valuta zamišljenog iznosa u kojoj su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijea ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijea 1: $0 < \text{vrijeme do dospijea} \leq 1$ mjesec</p> <p>Razred dospijea 2: $1 \text{ mjesec} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 3$ mjeseca</p> <p>Razred dospijea 3: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 6$ mjeseci</p> <p>Razred dospijea 4: $6 \text{ mjeseci} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospijea 5: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 2$ godine</p> <p>Razred dospijea 6: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 3$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijea m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq n$ godina</p>	50 000 000 EUR	10	

▼ M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti
<p>Inflacijski „jednovalutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice/terminski ugovori/opcije koji se odnose na inflacijske „jednovalutne ugovore o razmjeni”</p> <p>ugovor o razmjeni ili budućnosnica/terminski ugovor/opcija koji se odnose na ugovor o razmjeni u kojem dvije strane razmjenjuju novčane tokove u istoj valuti i u kojem su novčani tokovi barem jedne platne strane utvrđeni sa stopom inflacije</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP ili FONS ili FWOS ili OPTS</p> <p>RTS2#16 = IFSC</p>	<p>podrazred inflacijski jednovalutni ugovor o razmjeni definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS2#13) – valuta zamišljenog iznosa u kojoj su denominirane dvije platne strane ugovora o razmjeni</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospjeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospjeća 1: $0 < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 1 \text{ mjesec}$</p> <p>Razred dospjeća 2: $1 \text{ mjesec} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 3 \text{ mjeseca}$</p> <p>Razred dospjeća 3: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 6 \text{ mjeseci}$</p> <p>Razred dospjeća 4: $6 \text{ mjeseci} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 1 \text{ godina}$</p> <p>Razred dospjeća 5: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 2 \text{ godine}$</p> <p>Razred dospjeća 6: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 3 \text{ godine}$</p> <p>...</p> <p>Razred dospjeća m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq n \text{ godina}$</p>	50 000 000 EUR	10	

▼ M3

Razred imovine – kamatne izvedenice	
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija
Druge kamatne izvedenice Kamatna izvedenica koja ne pripada ni u koji od prethodno navedenih podrazreda imovine RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = OTHR	Smatra se da za sve druge kamatne izvedenice ne postoji likvidno tržište.

Tablica 5.2.

Kamatne izvedenice – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji

Razred imovine – kamatne izvedenice														
Podrazred imovine	Percentili i donji pragovi koje treba primijeniti za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji je utvrđeno da likvidno tržište postoji													
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja			LIS poslije trgovanja			
		Trgovanje – percentil				Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag
Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na obveznice	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Opcije na obveznice	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
		30	40	50	60									

▼B

Razred imovine – kamatne izvedenice														
Podrazred imovine	Percentili i donji pragovi koje treba primijeniti za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji je utvrđeno da likvidno tržište postoji													
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja			LIS poslije trgovanja			
		Trgovanje – percentil				Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag
Kamatne budućnosnice i terminski ugovori o stopi	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	5 000 000 EUR	70	10 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Kamatne opcije	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	5 000 000 EUR	70	10 000 000 EUR	80	60	20 000 000 EUR	90	70	25 000 000 EUR
		30	40	50	60									

▼B

Razred imovine – kamatne izvedenice														
Podrazred imovine	Percentili i donji pragovi koje treba primijeniti za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji je utvrđeno da likvidno tržište postoji													
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja			LIS poslije trgovanja			
		Trgovanje – percentil				Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag
Opcije razmjene	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
„Viševalutni ugovori o razmjeni” ili „međualutni ugovori o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na „viševalutne ugovore o razmjeni” ili „međualutne ugovore o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									

Razred imovine – kamatne izvedenice														
Podrazred imovine	Percentili i donji pragovi koje treba primijeniti za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji je utvrđeno da likvidno tržište postoji													
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja			LIS poslije trgovanja			
		Trgovanje – percentil				Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag
„Viševalutni ugovori o razmjeni” ili „međualutni ugovori o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na „viševalutne ugovore o razmjeni” ili „međualutne ugovore o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
„Viševalutni ugovori o razmjeni” ili „međualutni ugovori o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na „viševalutne ugovore o razmjeni” ili „međualutne ugovore o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									

Razred imovine – kamatne izvedenice														
Podrazred imovine	Percentili i donji pragovi koje treba primijeniti za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji je utvrđeno da likvidno tržište postoji													
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja			LIS poslije trgovanja			
		Trgovanje – percentil				Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag
Prekonoćni kamatni „viševalutni ili međuvalutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na prekonoćne kamatne „viševalutne ili međuvalutne ugovore o razmjeni”	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s finansijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Inflacijski „viševalutni ugovori o razmjeni” ili „međuvalutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na inflacijske „viševalutne ugovore o razmjeni” ili „međuvalutne ugovore o razmjeni”	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s finansijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									

Razred imovine – kamatne izvedenice														
Podrazred imovine	Percentili i donji pragovi koje treba primijeniti za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji je utvrđeno da likvidno tržište postoji													
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja			LIS poslije trgovanja			
		Trgovanje – percentil				Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag
„Jednovalutni ugovori o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na „jednovalutne ugovore o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
„Jednovalutni ugovori o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na „jednovalutne ugovore o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									

Razred imovine – kamatne izvedenice														
Podrazred imovine	Percentili i donji pragovi koje treba primijeniti za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji je utvrđeno da likvidno tržište postoji													
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja			LIS poslije trgovanja			
		Trgovanje – percentil				Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag
„Jednovalutni ugovori o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na „jednovalutne ugovore o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Prekonoćni kamatni jednovalutni ugovori o razmjeni i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na prekonoćne kamatne jednovalutne ugovore o razmjeni	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									

Razred imovine – kamatne izvedenice														
Podrazred imovine	Percentili i donji pragovi koje treba primijeniti za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji je utvrđeno da likvidno tržište postoji													
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja			LIS poslije trgovanja			
		Trgovanje – percentil				Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag
Inflacijski „jednovalutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na inflacijske „jednovalutne ugovore o razmjeni”	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	4 000 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	9 000 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									

Tablica 5.3.

Kamatne izvedenice – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište ne postoji

Razred imovine – kamatne izvedenice				
Podrazred imovine	Pragovi za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji je utvrđeno da likvidno tržište ne postoji			
	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
	Grafična vrijednost	Grafična vrijednost	Grafična vrijednost	Grafična vrijednost
Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na obveznice	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Opcije na obveznice	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Kamatne budućnosnice i terminski ugovori o stopi	5 000 000 EUR	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR

Razred imovine – kamatne izvedenice				
Podrazred imovine	Pragovi za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji je utvrđeno da likvidno tržište ne postoji			
	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
Kamatne opcije	5 000 000 EUR	10 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Opcije razmjene	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Viševalutni ugovori o razmjeni” ili „međualutni ugovori o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na „viševalutne ugovore o razmjeni” ili „međualutne ugovore o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Viševalutni ugovori o razmjeni” ili „međualutni ugovori o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na „viševalutne ugovore o razmjeni” ili „međualutne ugovore o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Viševalutni ugovori o razmjeni” ili „međualutni ugovori o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na „viševalutne ugovore o razmjeni” ili „međualutne ugovore o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Prekonoćni kamatni „viševalutni ili međualutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na prekonoćne kamatne „viševalutne ili međualutne ugovore o razmjeni”	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Inflacijski „viševalutni ugovori o razmjeni” ili „međualutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na inflacijske „viševalutne ugovore o razmjeni” ili „međualutne ugovore o razmjeni”	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Jednovalutni ugovori o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na „jednovalutne ugovore o razmjeni” fiksne za promjenjivu kamatnu stopu	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR

▼B

Razred imovine – kamatne izvedenice				
Podrazred imovine	Pragovi za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za svaki podrazred za koji je utvrđeno da likvidno tržište ne postoji			
	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
„Jednovalutni ugovori o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na „jednovalutne ugovore o razmjeni” promjenjive za promjenjivu kamatnu stopu	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
„Jednovalutni ugovori o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na „jednovalutne ugovore o razmjeni” fiksne za fiksnu kamatnu stopu	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Prekonoćni kamatni jednovalutni ugovori o razmjeni i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na prekonoćne kamatne jednovalutne ugovore o razmjeni	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Inflacijski „jednovalutni ugovori o razmjeni” i budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na inflacijske „jednovalutne ugovore o razmjeni”	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR
Druge kamatne izvedenice	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	9 000 000 EUR	10 000 000 EUR

6. Vlasničke izvedenice

▼M3

Tablica 6.1.

Vlasničke izvedenice – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – vlasničke izvedenice

Svi ugovori kako su definirani u odjeljku C točki 4. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU koji se odnose na:

- jednu ili više dionica, potvrde o deponiranim vrijednosnim papirima, certifikate, fondove čijim se udjelima trguje na burzi, certifikate, druge slične financijske instrumente, novčane tokove ili druge proizvode povezane s rezultatom jedne ili više dionica, potvrda o deponiranim vrijednosnim papirima, fondova čijim se udjelima trguje na burzi, certifikata ili drugih sličnih financijskih instrumenata;
- indeks dionica, potvrde o deponiranim vrijednosnim papirima, certifikate, fondove čijim se udjelima trguje na burzi, certifikate, druge slične financijske instrumente, novčane tokove ili ostale proizvode povezane s rezultatom jedne ili više dionica, potvrda o deponiranim vrijednosnim papirima, certifikata, fondova čijim se udjelima trguje na burzi ili drugih sličnih financijskih instrumenata

Razred imovine – vlasničke izvedenice	
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija
<p>Opcije na dionički indeks</p> <p>opcija čiji je odnosni instrument indeks sastavljen od dionica</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = STIX</p> <p>RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28</p>	<p>Smatra se da za sve opcije na indekse postoji likvidno tržište.</p>
<p>Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na dioničke indekse</p> <p>Budućnosnica/terminski ugovor čiji je odnosni instrument indeks sastavljen od dionica</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR ili FORW</p> <p>RTS2#27 = STIX</p> <p>RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28</p>	<p>Smatra se da za sve budućnosnice/terminske ugovore koji se odnose na indekse postoji likvidno tržište.</p>
<p>Dioničke opcije</p> <p>Opcija čiji je odnosni instrument dionica ili košarica dionica koja proizlazi iz korporativne akcije.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = SHRS</p> <p>RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28</p>	<p>Smatra se da za sve opcije na dionice postoji likvidno tržište.</p>

Razred imovine – vlasničke izvedenice	
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija
<p>Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na dionice</p> <p>Budućnosnica/terminski ugovor čiji je odnosni instrument dionica ili košarica dionica koja proizlazi iz korporativne akcije.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR ili FORW</p> <p>RTS2#27 = SHRS</p> <p>RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28</p>	<p>smatra se da za sve budućnosnice/terminske ugovore koji se odnose na dionice postoji likvidno tržište</p>
<p>Opcije na dividendu dionice</p> <p>opcija na dividendu određene dionice</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = DVSE</p> <p>RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28</p>	<p>Smatra se da za sve opcije na dividendu dionice postoji likvidno tržište.</p>
<p>Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na dividendu dionice</p> <p>budućnosnica/terminski ugovor koji se odnosi na dividendu određene dionice</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR ili FORW</p> <p>RTS2#27 = DVSE</p> <p>RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28</p>	<p>Smatra se da za sve budućnosnice/terminske ugovore koji se odnose na dividendu dionice postoji likvidno tržište.</p>

Razred imovine – vlasničke izvedenice	
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija
<p>Opcije na indeks dividendi</p> <p>Opcija na indeks sastavljen od dividendi na više od jedne dionice.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = DIVI</p> <p>RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28</p>	<p>Smatra se da za sve opcije na indeks dividendi postoji likvidno tržište.</p>
<p>Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na indeks dividendi</p> <p>Budućnosnica/terminski ugovor koji se odnosi na indeks sastavljen od dividendi na više od jedne dionice.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR ili FORW</p> <p>RTS2#27 = DIVI</p> <p>RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28</p>	<p>Smatra se da za sve budućnosnice/terminske ugovore koji se odnose na indeks dividendi postoji likvidno tržište.</p>
<p>Opcije na indeks volatilnosti</p> <p>Opcija čiji je odnosni instrument indeks volatilnosti koji se definira kao indeks koji se odnosi na volatilnost određenog odnosnog indeksa vlasničkih instrumenata.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = VOLI</p> <p>RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28</p>	<p>Smatra se da za sve opcije na indeks volatilnosti postoji likvidno tržište.</p>

Razred imovine – vlasničke izvedenice	
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija
<p>Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na indeks volatilnosti</p> <p>Budućnosnica/terminski ugovor čiji je odnosni instrument indeks volatilnosti koji se definira kao indeks koji se odnosi na volatilnost određenog odnosnog indeksa vlasničkih instrumenata</p> <p>RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR ili FORW RTS2#27 = VOLI RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28</p>	<p>Opcije na fondove čijim se udjelima trguje na burzi opcija čiji je odnosni instrument fond čijim se udjelima trguje na burzi</p>
<p>Opcije na fondove čijim se udjelima trguje na burzi</p> <p>opcija čiji je odnosni instrument fond čijim se udjelima trguje na burzi</p> <p>RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = ETFS RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28</p>	<p>Smatra se da za sve opcije na fondove čijim se udjelima trguje na burzi postoji likvidno tržište.</p>
<p>Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na fondove čijim se udjelima trguje na burzi</p> <p>Budućnosnica/terminski ugovor čiji je odnosni instrument fond čijim se udjelima trguje na burzi.</p> <p>RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = FUTR ili FORW RTS2#27 = ETFS RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28</p>	<p>Smatra se da za sve budućnosnice/terminske ugovore koji se odnose na fondove čijim se udjelima trguje na burzi postoji likvidno tržište.</p>

Razred imovine – vlasničke izvedenice					
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti			
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]		
Ugovori o razmjeni RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = SWAP	Podrazred ugovori o razmjeni definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije 1 (RTS2#27) – vrsta odnosno instrumenta: jedan subjekt, indeks, košarica Kriterij segmentacije 2 (RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28) – vrsta odnosno instrumenta: jedan subjekt, indeks, košarica Kriterij segmentacije 3 (RTS2#28) – parametar: rezultat na osnovi cijene, rezultat na osnovi dividende, rezultat na osnovi varijance, rezultat na osnovi volatilnosti Kriterij segmentacije 4 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijea ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:	50 000 000 EUR			
	Parametar rezultat na osnovi cijene			Parametar rezultat na osnovi varijance/volatilnosti	Parametar rezultat na osnovi dividende
	Razred dospijea 1: 0 < vrijeme do dospijea ≤ 1 mjesec			Razred dospijea 1: 0 < vrijeme do dospijea ≤ 3 mjeseca	Razred dospijea 1: 0 < vrijeme do dospijea ≤ 1 godina
	Razred dospijea 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijea ≤ 3 mjeseca			Razred dospijea 2: 3 mjeseca < vrijeme do dospijea ≤ 6 mjeseci	Razred dospijea 2: 1 godina < vrijeme do dospijea ≤ 2 godine
	Razred dospijea 3: 3 mjeseca < vrijeme do dospijea ≤ 6 mjeseci			Razred dospijea 3: 6 mjeseci < vrijeme do dospijea ≤ 1 godina	Razred dospijea 3: 2 godine < vrijeme do dospijea ≤ 3 godine
	Razred dospijea 4: 6 mjeseci < vrijeme do dospijea ≤ 1 godina			Razred dospijea 4: 1 godina < vrijeme do dospijea ≤ 2 godine	...

Razred imovine – vlasničke izvedenice					
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku			Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
				Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
	Razred dospijeća 5: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine	Razred dospijeća 5: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina		
	Razred dospijeća 6: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine	...			
	...	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina			
	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina				
Ugovori o razmjeni na razini portfelja RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = PSWP	Podrazred ugovori o razmjeni na razini portfelja definiran je sljedećom posebnom kombinacijom: Kriterij segmentacije 1 (RTS2#27) – vrsta odnosnog instrumenta: jedan subjekt, indeks, košarica Kriterij segmentacije 2 (RTS23#26 ili, ako je nula, RTS23#28) – vrsta odnosnog instrumenta: jedan subjekt, indeks, košarica Kriterij segmentacije 3 (RTS2#28) – parametar: rezultat na osnovi cijene, rezultat na osnovi dividende, rezultat na osnovi varijance, rezultat na osnovi volatilnosti Kriterij segmentacije 4 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi: Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec Razred dospijeća 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca Razred dospijeća 3: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci Razred dospijeća 4: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina Razred dospijeća 5: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine Razred dospijeća 6: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine ... Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina			50 000 000 EUR	15

▼ M3

Razred imovine – vlasničke izvedenice	
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija
Druge kreditne izvedenice Kreditna izvedenica koja ne pripada ni u jedan od prethodno navedenih podrazreda imovine RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OTHR	Smatra se da za sve druge vlasničke izvedenice ne postoji likvidno tržište.

▼ B

Tablica 6.2.

Vlasničke izvedenice – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji

Razred imovine – vlasničke izvedenice							
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja, svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	Vrijednosti pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja utvrđene za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) u koju podrazred pripada				
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
				Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
Opcije na dionički indeks	podrazred opcija na dionički indeks definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije br. 1. – odnosni dionički indeks	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred uzimajući u obzir transakcije izvršene s finansijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	ADNA < 100 mil. EUR	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mil. EUR ≤ ADNA < 600 mil. EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 mil. EUR	15 000 000 EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

Razred imovine – vlasničke izvedenice							
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja, svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	Vrijednosti pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja utvrđene za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) u koju podrazred pripada				
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
				Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na dioničke indekse	podrazred budućnosnica/terminski ugovor koji se odnosi na dionički indeks definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije br. 1. – odnosni dionički indeks	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	ADNA < 100 mil. EUR	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 1 mlrd. EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mlrd. EUR ≤ ADNA < 3 mlrd. EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mlrd. EUR ≤ ADNA < 5 mlrd. EUR	15 000 000 EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 mlrd. EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Opcije dionice	podrazred opcija na dionice definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije br. 1. – odnosna dionica	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	ADNA < 5 mil. EUR	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	250 000 EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

Razred imovine – vlasničke izvedenice							
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja, svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	Vrijednosti pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja utvrđene za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) u koju podrazred pripada				
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
				Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na dionice	podrazred budućnosnica/terminski ugovor koji se odnosi na dionice definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije br. 1. – odnosna dionica	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	ADNA < 5 mil. EUR	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	250 000 EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
Opcije na dividendu dionice	podrazred opcija na dividendu dionice definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije br. 1. – odnosna dionica na temelju koje se ostvaruje pravo na dividendu	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	ADNA < 5 mil. EUR	20 000 EUR	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	25 000 EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	50 000 EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	100 000 EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR

Razred imovine – vlasničke izvedenice							
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja, svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	Vrijednosti pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja utvrđene za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) u koju podrazred pripada				
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
				Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na dividendu dionice	podrazred budućnosnica/terminski ugovor koji se odnosi na dividendu dionice definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije br. 1. – odnosna dionica na temelju koje se ostvaruje pravo na dividendu	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	ADNA < 5 mil. EUR	20 000 EUR	25 000 EUR	400 000 EUR	450 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	25 000 EUR	30 000 EUR	500 000 EUR	550 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	50 000 EUR	100 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	100 000 EUR	150 000 EUR	2 000 000 EUR	2 500 000 EUR
Opcije na indeks dividendi	podrazred opcija na indeks dividendi definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije br. 1. – odnosni indeks dividendi	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	ADNA < 100 mil. EUR	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mil. EUR ≤ ADNA < 600 mil. EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 mil. EUR	15 000 000 EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

Razred imovine – vlasničke izvedenice							
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja, svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	Vrijednosti pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja utvrđene za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) u koju podrazred pripada				
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
				Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na indeks dividendi	podrazred budućnosnica/terminski ugovor koji se odnosi na indeks dividendi definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije br. 1. – odnosni indeks dividendi	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	ADNA < 100 mil. EUR	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 1 mlrd. EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mlrd. EUR ≤ ADNA < 3 mlrd. EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mlrd. EUR ≤ ADNA < 5 mlrd. EUR	15 000 000 EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 mlrd. EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Opcije na indeks volatilnosti	podrazred opcija na indeks volatilnosti definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije br. 1. – odnosni indeks volatilnosti	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	ADNA < 100 mil. EUR	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR
			200 mil. EUR ≤ ADNA < 600 mil. EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			ADNA ≥ 600 mil. EUR	15 000 000 EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR

Razred imovine – vlasničke izvedenice							
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja, svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	Vrijednosti pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja utvrđene za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) u koju podrazred pripada				
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
				Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na indeks volatilnosti	podrazred budućnosnica/terminski ugovor koji se odnosi na indeks volatilnosti definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije br. 1. – odnosni indeks volatilnosti	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	ADNA < 100 mil. EUR	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 1 mlrd. EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
			1 mlrd. EUR ≤ ADNA < 3 mlrd. EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR	50 000 000 EUR	55 000 000 EUR
			3 mlrd. EUR ≤ ADNA < 5 mlrd. EUR	15 000 000 EUR	20 000 000 EUR	150 000 000 EUR	160 000 000 EUR
			ADNA ≥ 5 mlrd. EUR	25 000 000 EUR	30 000 000 EUR	250 000 000 EUR	260 000 000 EUR
Opcije na fondove čijim se udjelima trguje na burzi	podrazred opcija na fondove čijim se udjelima trguje na burzi definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije br. 1. – odnosni fond čijim se udjelima trguje na burzi	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	ADNA < 5 mil. EUR	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	250 000 EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

Razred imovine – vlasničke izvedenice							
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja, svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	Vrijednosti pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja utvrđene za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) u koju podrazred pripada				
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
				Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
Budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na fondove čijim se udjelima trguje na burzi	podrazred budućnosnica/terminski ugovor koji se odnosi na fondove čijim se udjelima trguje na burzi definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije br. 1. – odnosni fond čijim se udjelima trguje na burzi	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	ADNA < 5 mil. EUR	20 000 EUR	25 000 EUR	1 000 000 EUR	1 250 000 EUR
			5 mil. EUR ≤ ADNA < 10 mil. EUR	250 000 EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			10 mil. EUR ≤ ADNA < 20 mil. EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 20 mil. EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
Ugovori o razmjeni	podrazred ugovori o razmjeni definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije br. 1. – vrsta odnosnog instrumenta: jedan subjekt, indeks, košarica Kriterij segmentacije br. 2. – odnosni jedan subjekt, indeks, košarica Kriterij segmentacije br. 3. – parametar: parametar <i>price return basic performance</i> (rezultat na osnovi cijene), parametar <i>return dividend</i> (rezultat na osnovi dividende), parametar <i>return variance</i> (rezultat na osnovi varijance), parametar <i>return volatility</i> (rezultat na osnovi volatilnosti) Kriterij segmentacije br. 4. – vrijeme do razreda dospjeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	50 mil. EUR ≤ ADNA < 100 mil. EUR	250 000 EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 200 mil. EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR

Razred imovine – vlasničke izvedenice									
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja, svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku			Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	Vrijednosti pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja utvrđene za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) u koju podrazred pripada				
					Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
						Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
	<i>Parametar price return basic performance</i>	<i>Parametar return variance/volatility</i>	<i>Parametar return dividend</i>						
	Razred dospjeća br. 1.: 0 < vrijeme do dospjeća ≤ 1 mjesec	Razred dospjeća br. 1.: 0 < vrijeme do dospjeća ≤ 3 mjeseca	Razred dospjeća br. 1.: 0 mjeseci < vrijeme do dospjeća ≤ 1 godina						
	Razred dospjeća br. 2.: 1 mjesec < vrijeme do dospjeća ≤ 3 mjeseca	Razred dospjeća br. 2.: 3 mjeseca < vrijeme do dospjeća ≤ 6 mjeseci	Razred dospjeća br. 2.: 1 godina < vrijeme do dospjeća ≤ 2 godine						
	Razred dospjeća br. 3.: 3 mjeseca < vrijeme do dospjeća ≤ 6 mjeseci	Razred dospjeća br. 3.: 6 mjeseci < vrijeme do dospjeća ≤ 1 godina	Razred dospjeća br. 3.: 2 godine < vrijeme do dospjeća ≤ 3 godine						

Razred imovine – vlasničke izvedenice									
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja, svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku			Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	Vrijednosti pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja utvrđene za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) u koju podrazred pripada				
					Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
						Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
	Razred dospjeća br. 4.: 6 mjeseci < vrijeme do dospjeća ≤ 1 godina	Razred dospjeća br. 4.: 1 godina < vrijeme do dospjeća ≤ 2 godine	...						
	Razred dospjeća br. 5.: 1 godina < vrijeme do dospjeća ≤ 2 godine	Razred dospjeća br. 5.: 2 godine < vrijeme do dospjeća ≤ 3 godine	Razred dospjeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospjeća ≤ n godina						
	Razred dospjeća br. 6.: 2 godine < vrijeme do dospjeća ≤ 3 godine	...							
	...	Razred dospjeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospjeća ≤ n godina							
	Razred dospjeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospjeća ≤ n godina								

Razred imovine – vlasničke izvedenice							
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja, svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	Vrijednosti pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja utvrđene za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) u koju podrazred pripada				
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
				Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
Ugovori o razmjeni na razini portfelja	podrazred ugovori o razmjeni na razini portfelja definiran je sljedećom posebnom kombinacijom: Kriterij segmentacije br. 1. – vrsta odnosnog instrumenta: jedan subjekt, indeks, košarica Kriterij segmentacije br. 2. – odnosni jedan subjekt, indeks, košarica Kriterij segmentacije br. 3. – parametar: parametar <i>price return basic performance</i> (rezultat na osnovi cijene), parametar <i>return dividend</i> (rezultat na osnovi dividende), parametar <i>return variance</i> (rezultat na osnovi varijance), parametar <i>return volatility</i> (rezultat na osnovi volatilnosti) Kriterij segmentacije br. 4. – vrijeme do razreda dospijea ugovora o razmjeni na razini portfelja definirano je kako slijedi:	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	50 mil. EUR ≤ ADNA < 100 mil. EUR	250 000 EUR	300 000 EUR	1 250 000 EUR	1 500 000 EUR
			100 mil. EUR ≤ ADNA < 200 mil. EUR	500 000 EUR	550 000 EUR	2 500 000 EUR	3 000 000 EUR
			ADNA ≥ 200 mil. EUR	1 000 000 EUR	1 500 000 EUR	5 000 000 EUR	5 500 000 EUR
	Razred dospijea br. 1.: 0 < vrijeme do dospijea ≤ 1 mjesec						
	Razred dospijea br. 2.: 1 mjesec < vrijeme do dospijea ≤ 3 mjeseca						
	Razred dospijea br. 3.: 3 mjeseca < vrijeme do dospijea ≤ 6 mjeseci						

Razred imovine – vlasničke izvedenice							
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja, svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	Vrijednosti pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja utvrđene za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji na temelju kategorije prosječnog dnevnog zamišljenog iznosa (ADNA) u koju podrazred pripada				
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA)	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
				Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
	Razred dospjeća br. 4.: 6 mjeseci < vrijeme do dospjeća ≤ 1 godina						
	Razred dospjeća br. 5.: 1 godina < vrijeme do dospjeća ≤ 2 godine						
	Razred dospjeća br. 6.: 2 godine < vrijeme do dospjeća ≤ 3 godine						
	...						
	Razred dospjeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospjeća ≤ n godina						

Tablica 6.3.

Vlasničke izvedenice – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – vlasničke izvedenice				
Podrazred imovine	Pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da ne postoji likvidno tržište			
	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
Ugovori o razmjeni	20 000 EUR	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR
Ugovori o razmjeni na razini portfelja	20 000 EUR	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR
Druge vlasničke izvedenice	20 000 EUR	25 000 EUR	100 000 EUR	150 000 EUR

▼B

7. Robne izvedenice

▼M3

Tablica 7.1.

Robne izvedenice – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – robne izvedenice											
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti									
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]								
Robne budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na metale RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS23#35 = METL i [RTS2#5 = FUTR ili FORW]	Podrazred robna budućnosnica/terminski ugovor koji se odnosi na metale definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije 1 (RTS23#36) – vrsta metala: plemeniti metali, neplemeniti metali Kriterij segmentacije 2 (RTS23#37) – odnosni metal Kriterij segmentacije 3 (RTS2#15) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa budućnosnice/terminskog ugovora Kriterij segmentacije 4 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospjeća budućnosnice definirano je kako slijedi:	10 000 000 EUR	10								
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>Plemeniti metali</th> <th>Neplemeniti metali</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Razred dospjeća 1: 0 < vrijeme do dospjeća ≤ 3 mjeseca</td> <td>Razred dospjeća 1: 0 < vrijeme do dospjeća ≤ 1 godina</td> </tr> <tr> <td>Razred dospjeća 2: 3 mjeseca < vrijeme do dospjeća ≤ 1 godina</td> <td>Razred dospjeća 2: 1 godina < vrijeme do dospjeća ≤ 2 godine</td> </tr> <tr> <td>Razred dospjeća 3: 1 godina < vrijeme do dospjeća ≤ 2 godine</td> <td>Razred dospjeća 3: 2 godine < vrijeme do dospjeća ≤ 3 godine</td> </tr> </tbody> </table>			Plemeniti metali	Neplemeniti metali	Razred dospjeća 1: 0 < vrijeme do dospjeća ≤ 3 mjeseca	Razred dospjeća 1: 0 < vrijeme do dospjeća ≤ 1 godina	Razred dospjeća 2: 3 mjeseca < vrijeme do dospjeća ≤ 1 godina	Razred dospjeća 2: 1 godina < vrijeme do dospjeća ≤ 2 godine	Razred dospjeća 3: 1 godina < vrijeme do dospjeća ≤ 2 godine	Razred dospjeća 3: 2 godine < vrijeme do dospjeća ≤ 3 godine
	Plemeniti metali			Neplemeniti metali							
	Razred dospjeća 1: 0 < vrijeme do dospjeća ≤ 3 mjeseca			Razred dospjeća 1: 0 < vrijeme do dospjeća ≤ 1 godina							
	Razred dospjeća 2: 3 mjeseca < vrijeme do dospjeća ≤ 1 godina			Razred dospjeća 2: 1 godina < vrijeme do dospjeća ≤ 2 godine							
Razred dospjeća 3: 1 godina < vrijeme do dospjeća ≤ 2 godine	Razred dospjeća 3: 2 godine < vrijeme do dospjeća ≤ 3 godine										

Razred imovine – robne izvedenice				
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku		Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
	Razred dospjeća 4: 2 godine < vrijeme do dospjeća ≤ 3 godine	...		
	...	Razred dospjeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospjeća ≤ n godina		
	Razred dospjeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospjeća ≤ n godina			
Robne opcije koje se odnose na metale RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS23#35 = METL i RTS2#5 = OPTN	Podrazred robne opcije koje se odnose na metale definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije 1 (RTS23#36) – vrsta metala: plemeniti metali, neplemeniti metali Kriterij segmentacije 2 (RTS23#37) – odnosni metal Kriterij segmentacije 3 (RTS2#15) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa opcije Kriterij segmentacije 4 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospjeća opcije definirano je kako slijedi:		10 000 000 EUR	10
	Plemeniti metali	Neplemeniti metali		
	Razred dospjeća 1: 0 < vrijeme do dospjeća ≤ 3 mjeseca	Razred dospjeća 1: 0 < vrijeme do dospjeća ≤ 1 godina		
	Razred dospjeća 2: 3 mjeseca < vrijeme do dospjeća ≤ 1 godina	Razred dospjeća 2: 1 godina < vrijeme do dospjeća ≤ 2 godine		

Razred imovine – robne izvedenice				
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku		Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
	Razred dospijeća 3: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine	Razred dospijeća 3: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine		
	Razred dospijeća 4: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine	...		
	...	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina		
	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina			
Robni ugovori o razmjeni koji se odnose na metale RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS2#35 = METL i RTS2#5 = SWAP	Podrazred robni ugovori o razmjeni koji se odnose na metale definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:		10 000 000 EUR	10
	Kriterij segmentacije 1 (RTS23#36) – vrsta metala: plemeniti metali, neplemeniti metali			
	Kriterij segmentacije 2 (RTS23#37) – odnosni metal			
Kriterij segmentacije 3 (RTS2#15) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa ugovora o razmjeni				
Kriterij segmentacije 4 (RTS23#34) – vrsta isporuke definirana je kao u gotovini, fizički ili drugo				
Kriterij segmentacije 5 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:				
	Plemeniti metali	Neplemeniti metali		
	Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 3 mjeseca	Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina		

Razred imovine – robne izvedenice				
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku		Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
			Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
	Razred dospijeća 2: 3 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina	Razred dospijeća 2: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine		
	Razred dospijeća 3: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine	Razred dospijeća 3: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine		
	Razred dospijeća 4: 2 godine < vrijeme do dospijeća ≤ 3 godine	...		
	...	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina		
	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina			
Robne budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na energente RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS23#35 = NRGY i [RTS2#5 = FUTR ili FORW]	Podrazred robna budućnosnica/terminski ugovor koji se odnosi na energente definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije 1 (RTS23#36) – vrsta energenta: nafta, naftni derivati, ugljen, lake frakcije nafte, prirodni plin, električna energija, kombinacija energetske izvora Kriterij segmentacije 2 (RTS23#37) – odnosni energent Kriterij segmentacije 3 (RTS2#15) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa budućnosnice/terminskog ugovora Kriterij segmentacije 4 – [brisan]		10 000 000 EUR	10

Razred imovine – robne izvedenice																								
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti																						
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]																					
	<p>Kriterij segmentacije 5 (RTS2#14) – mjesto isporuke / namire u novcu primjenjivo na vrste energenata</p> <p>Kriterij segmentacije 6 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća budućnosnice/terminskog ugovora definirano je kako slijedi:</p>																							
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>Nafta/naftni derivati/lake frakcije nafte</th> <th>Ugljen</th> <th>Prirodni plin/električna energija/kombinacija energetskih izvora</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 4 mjeseca</td> <td>Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci</td> <td>Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec</td> </tr> <tr> <td>Razred dospijeća 2: 4 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 8 mjeseci</td> <td>Razred dospijeća 2: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina</td> <td>Razred dospijeća 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina</td> </tr> <tr> <td>Razred dospijeća 3: 8 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina</td> <td>Razred dospijeća 3: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine</td> <td>Razred dospijeća 3: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine</td> </tr> <tr> <td>Razred dospijeća 4: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine</td> <td>...</td> <td>...</td> </tr> <tr> <td>...</td> <td>Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina</td> <td>Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina</td> </tr> <tr> <td>Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina</td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>	Nafta/naftni derivati/lake frakcije nafte	Ugljen	Prirodni plin/električna energija/kombinacija energetskih izvora	Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 4 mjeseca	Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci	Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec	Razred dospijeća 2: 4 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 8 mjeseci	Razred dospijeća 2: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina	Razred dospijeća 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina	Razred dospijeća 3: 8 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina	Razred dospijeća 3: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine	Razred dospijeća 3: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine	Razred dospijeća 4: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina				
Nafta/naftni derivati/lake frakcije nafte	Ugljen	Prirodni plin/električna energija/kombinacija energetskih izvora																						
Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 4 mjeseca	Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci	Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec																						
Razred dospijeća 2: 4 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 8 mjeseci	Razred dospijeća 2: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina	Razred dospijeća 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina																						
Razred dospijeća 3: 8 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina	Razred dospijeća 3: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine	Razred dospijeća 3: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine																						
Razred dospijeća 4: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine																						
...	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina																						
Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina																								

Razred imovine – robne izvedenice															
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti													
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]												
Robne opcije koje se odnose na energente RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS23#35 = NRGY i RTS2#5 = OPTN	Podrazred robne opcije koje se odnose na energente definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije 1 (RTS23#36) – vrsta energenta: nafta, naftni derivati, ugljen, lake frakcije nafte, prirodni plin, električna energija, kombinacija energetskih izvora Kriterij segmentacije 2 (RTS23#37) – odnosni energent Kriterij segmentacije 3 (RTS2#15) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa opcije Kriterij segmentacije 4 – [brisano] Kriterij segmentacije 5 (RTS2#14) – mjesto isporuke / namire u novcu primjenjivo na vrste energenata Kriterij segmentacije 6 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijea opcije definirano je kako slijedi:	10 000 000 EUR	10												
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>Nafta/naftni derivati/lake frakcije nafte</th> <th>Ugljen</th> <th>Prirodni plin/električna energija/kombinacija energetskih izvora</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td> Razred dospijea 1: 0 < vrijeme do dospijea ≤ 4 mjeseca </td> <td> Razred dospijea 1: 0 < vrijeme do dospijea ≤ 6 mjeseci </td> <td> Razred dospijea 1: 0 < vrijeme do dospijea ≤ 1 mjesec </td> </tr> <tr> <td> Razred dospijea 2: 4 mjeseca < vrijeme do dospijea ≤ 8 mjeseci </td> <td> Razred dospijea 2: 6 mjeseci < vrijeme do dospijea ≤ 1 godina </td> <td> Razred dospijea 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijea ≤ 1 godina </td> </tr> </tbody> </table>				Nafta/naftni derivati/lake frakcije nafte	Ugljen	Prirodni plin/električna energija/kombinacija energetskih izvora	Razred dospijea 1: 0 < vrijeme do dospijea ≤ 4 mjeseca	Razred dospijea 1: 0 < vrijeme do dospijea ≤ 6 mjeseci	Razred dospijea 1: 0 < vrijeme do dospijea ≤ 1 mjesec	Razred dospijea 2: 4 mjeseca < vrijeme do dospijea ≤ 8 mjeseci	Razred dospijea 2: 6 mjeseci < vrijeme do dospijea ≤ 1 godina	Razred dospijea 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijea ≤ 1 godina		
	Nafta/naftni derivati/lake frakcije nafte				Ugljen	Prirodni plin/električna energija/kombinacija energetskih izvora									
	Razred dospijea 1: 0 < vrijeme do dospijea ≤ 4 mjeseca				Razred dospijea 1: 0 < vrijeme do dospijea ≤ 6 mjeseci	Razred dospijea 1: 0 < vrijeme do dospijea ≤ 1 mjesec									
Razred dospijea 2: 4 mjeseca < vrijeme do dospijea ≤ 8 mjeseci	Razred dospijea 2: 6 mjeseci < vrijeme do dospijea ≤ 1 godina	Razred dospijea 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijea ≤ 1 godina													

Razred imovine – robne izvedenice					
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku			Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
				Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
	Razred dospjeća 3: 8 mjeseci < vrijeme do dospjeća ≤ 1 godina	Razred dospjeća 3: 1 godina < vrijeme do dospjeća ≤ 2 godine	Razred dospjeća 3: 1 godina < vrijeme do dospjeća ≤ 2 godine		
	Razred dospjeća 4: 1 godina < vrijeme do dospjeća ≤ 2 godine		
	...	Razred dospjeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospjeća ≤ n godina	Razred dospjeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospjeća ≤ n godina		
	Razred dospjeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospjeća ≤ n godina				
Robni ugovori o razmjeni koji se odnose na energente RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS2#35 = NRGY i RTS2#5 = SWAP	Podrazred robni ugovori o razmjeni koji se odnose na energente definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije 1 (RTS23#36) – vrsta energenta: nafta, naftni derivati, ugljen, lake frakcije nafte, prirodni plin, električna energija, kombinacija energetskih izvora Kriterij segmentacije 2 (RTS23#37) – odnosni energent Kriterij segmentacije 3 (RTS2#15) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa ugovora o razmjeni Kriterij segmentacije 4 (RTS23#34) – vrsta isporuke definirana je kao u gotovini, fizički ili drugo Kriterij segmentacije 5 – [brisan] Kriterij segmentacije 6 (RTS2#14) – mjesto isporuke / namire u novcu primjenjivo na vrste energenata Kriterij segmentacije 7 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospjeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:			10 000 000 EUR	10

Razred imovine – robne izvedenice					
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku			Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
				Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
	Nafta/naftni derivati/lake frakcije nafte	Ugljen	Prirodni plin/električna energija/kombinacija energetskih izvora		
	Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 4 mjeseca	Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 6 mjeseci	Razred dospijeća 1: 0 < vrijeme do dospijeća ≤ 1 mjesec		
	Razred dospijeća 2: 4 mjeseca < vrijeme do dospijeća ≤ 8 mjeseci	Razred dospijeća 2: 6 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina	Razred dospijeća 2: 1 mjesec < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina		
	Razred dospijeća 3: 8 mjeseci < vrijeme do dospijeća ≤ 1 godina	Razred dospijeća 3: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine	Razred dospijeća 3: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine		
	Razred dospijeća 4: 1 godina < vrijeme do dospijeća ≤ 2 godine		
	...	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina		
	Razred dospijeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeća ≤ n godina				
Robne budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na poljoprivredne proizvode RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS23#35 = AGRI i [RTS2#5 = FUTR ili FORW]	Podrazred robna budućnosnica/terminski ugovor koji se odnosi na poljoprivredne proizvode definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije 1 (RTS23#36 i RTS23#37) – odnosni poljoprivredni proizvod (potproizvod i daljnji potproizvod) Kriterij segmentacije 2 (RTS2#15) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa budućnosnice/terminskog ugovora			10 000 000 EUR	10

Razred imovine – robne izvedenice			
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
	<p>Kriterij segmentacije 3 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeca budućnosnice/terminskog ugovora definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijeca 1: $0 < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 3$ mjeseca</p> <p>Razred dospijeca 2: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 6$ mjeseci</p> <p>Razred dospijeca 3: $6 \text{ mjeseci} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospijeca 4: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 2$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijeca m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq n$ godina</p>		
<p>Robne opcije koje se odnose na poljoprivredne proizvode</p> <p>RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS23#35 = AGRI i RTS2#5 = OPTN</p>	<p>Podrazred robne opcije koja se odnosi na poljoprivredni proizvod definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS23#36 i RTS23#37) – odnosni poljoprivredni proizvod (potproizvod i daljnji potproizvod)</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#15) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa opcije</p> <p>Kriterij segmentacije 3 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeca opcije definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijeca 1: $0 < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 3$ mjeseca</p> <p>Razred dospijeca 2: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 6$ mjeseci</p> <p>Razred dospijeca 3: $6 \text{ mjeseci} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospijeca 4: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 2$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijeca m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq n$ godina</p>	10 000 000 EUR	10

Razred imovine – robne izvedenice			
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Robni ugovori o razmjeni koji se odnose na poljoprivredne proizvode RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS23#35 = AGRI i RTS2#5 = SWAP	podrazred robni ugovori o razmjeni koji se odnose na poljoprivredne proizvode definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije 1 (RTS23#36 i RTS23#37) – odnosni poljoprivredni proizvod (potproizvod i daljnji potproizvod) Kriterij segmentacije 2 (RTS2#15) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa ugovora o razmjeni Kriterij segmentacije 3 (RTS23#34) – vrsta isporuke definirana je kao u gotovini, fizički ili drugo Kriterij segmentacije 4 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijea ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi: Razred dospijea 1: $0 < \text{vrijeme do dospijea} \leq 3$ mjeseca Razred dospijea 2: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 6$ mjeseci Razred dospijea 3: $6 \text{ mjeseci} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 1$ godina Razred dospijea 4: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 2$ godine ... Razred dospijea m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq n$ godina	10 000 000 EUR	10
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija		
Druge robne izvedenice robna izvedenica koja ne pripada ni u jedan od prethodno navedenih podrazreda imovine	Smatra se da za sve druge robne izvedenice ne postoji likvidno tržište.		

Tablica 7.2.

Robne izvedenice – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji

Razred imovine – robne izvedenice														
Podrazred imovine	Percentili i donji pragovi koje treba primijeniti za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji													
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja			LIS poslije trgovanja			
		Trgovanje – percentil				Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag
Robne budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na metale	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	250 000 EUR	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Robne opcije koje se odnose na metale	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	250 000 EUR	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
		30	40	50	60									

Razred imovine – robne izvedenice														
Podrazred imovine	Percentili i donji pragovi koje treba primijeniti za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji													
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja			LIS poslije trgovanja			
		Trgovanje – percentil				Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag
Robni ugovori o razmjeni koji se odnose na metale	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	250 000 EUR	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Robne budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na energente	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	250 000 EUR	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Robne opcije koje se odnose na energente	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene	S1	S2	S3	S4	250 000 EUR	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
		30	40	50	60									

▼B

Razred imovine – robne izvedenice														
Podrazred imovine	Percentili i donji pragovi koje treba primijeniti za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji													
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja			LIS poslije trgovanja			
		Trgovanje – percentil		Donji prag		Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	
	s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred													
Robni ugovori o razmjeni koji se odnose na energente	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	250 000 EUR	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Robne budućnosnice/ terminski ugovori koji se odnose na poljoprivredne proizvode	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	250 000 EUR	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
		30	40	50	60									

▼B

Razred imovine – robne izvedenice														
Podrazred imovine	Percentili i donji pragovi koje treba primijeniti za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji													
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja			LIS poslije trgovanja			
		Trgovanje – percentil				Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag
Robne opcije koje se odnose na poljoprivredne proizvode	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1 30	S2 40	S3 50	S4 60	250 000 EUR	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR
Robni ugovori o razmjeni koji se odnose na poljoprivredne proizvode	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1 30	S2 40	S3 50	S4 60	250 000 EUR	70	500 000 EUR	80	60	750 000 EUR	90	70	1 000 000 EUR

Tablica 7.3.

Robne izvedenice – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – robne izvedenice				
Podrazred imovine	Pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da ne postoji likvidno tržište			
	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
Robne budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na metale	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Robne opcije koje se odnose na metale	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Robni ugovori o razmjeni koji se odnose na metale	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Robne budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na energente	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Robne opcije koje se odnose na energente	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Robni ugovori o razmjeni koji se odnose na energente	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Robne budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na poljoprivredne proizvode	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Robne opcije koje se odnose na poljoprivredne proizvode	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Robni ugovori o razmjeni koji se odnose na poljoprivredne proizvode	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR
Druge robne izvedenice	250 000 EUR	500 000 EUR	750 000 EUR	1 000 000 EUR

▼B

8. Valutne izvedenice

▼M3

Tablica 8.1.

Valutne izvedenice – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – valutne izvedenice			
financijski instrument koji se odnosi na valute kako je definirano u odjeljku C točki 4. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU			
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
<p>Terminski ugovor bez isporuke (NDF)</p> <p>Terminski ugovor koji ugovorne strane, prema ugovornim uvjetima, namiruju u novcu, pri čemu se iznos za namiru utvrđuje na temelju razlike u tečaju dviju valuta na datum trgovanja i datum vrednovanja. Na datum namire jedna će strana drugoj strani dugovati neto razliku između i. tečaja na datum trgovanja i ii. tečaja na datum vrednovanja, na osnovi zamišljenog iznosa, i taj će se neto iznos isplatiti u valuti namire koja je utvrđena ugovorom.</p> <p>RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FORW RTS2#26 = NDLV</p>	<p>Podrazred valutni terminski ugovor bez isporuke definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS23#13 i RTS23#47) – odnosni valutni par definiran je kao kombinacija dviju valuta koje su odnosni instrument ugovora o izvedenici</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijea terminskog ugovora definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijea 1: $0 < \text{vrijeme do dospijea} \leq 1$ tjedan</p> <p>Razred dospijea 2: $1 \text{ tjedan} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 3$ mjeseca</p> <p>Razred dospijea 3: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospijea 4: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 2$ godine</p> <p>Razred dospijea 5: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 3$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijea m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq n$ godina</p>	<p>Smatra se da za terminske ugovore bez isporuke (NDF) ne postoji likvidno tržište.</p>	

Razred imovine – valutne izvedenice			
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
<p>Terminski ugovor s isporukom (DF)</p> <p>Terminski ugovor koji obuhvaća samo razmjenu dviju različitih valuta na određeni budući ugovoreni datum namire po fiksnoj stopi dogovorenoj pri sklapanju ugovora o razmjeni.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = FORW</p> <p>RTS2#26 = DLVB</p>	<p>Podrazred valutni terminski ugovor s isporukom definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS23#13 i RTS23#47) – odnosni valutni par definiran je kao kombinacija dviju valuta koje su odnosni instrument ugovora o izvedenici</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća terminskog ugovora definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijeća 1: $0 < \text{vrijeme do dospijeća} \leq 1$ tjedan</p> <p>Razred dospijeća 2: $1 \text{ tjedan} < \text{vrijeme do dospijeća} \leq 3$ mjeseca</p> <p>Razred dospijeća 3: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospijeća} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospijeća 4: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeća} \leq 2$ godine</p> <p>Razred dospijeća 5: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospijeća} \leq 3$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijeća m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeća} \leq n$ godina</p>	<p>Smatra se da za terminske ugovore s isporukom ne postoji likvidno tržište.</p>	

Razred imovine – valutne izvedenice			
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
<p>Valutne opcije bez isporuke (NDO)</p> <p>Opcija koju ugovorne strane, prema ugovornim uvjetima, namiruju u novcu, pri čemu se iznos za namiru utvrđuje na temelju razlike u tečaju dviju valuta na datum trgovanja i datum vrednovanja. Na datum namire jedna će strana drugoj strani dugovati neto razliku između i. tečaja na datum trgovanja i ii. tečaja na datum vrednovanja, na osnovi zamišljenog iznosa, i taj će se neto iznos isplatiti u valuti namire koja je utvrđena ugovorom.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#26 = NDLV</p>	<p>Podrazred valutna opcija bez isporuke definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS23#13 i RTS23#47) – odnosni valutni par definiran je kao kombinacija dviju valuta koje su odnosni instrument ugovora o izvedenici</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeca opcije definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijeca 1: $0 < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 1$ tjedan</p> <p>Razred dospijeca 2: $1 \text{ tjedan} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 3$ mjeseca</p> <p>Razred dospijeca 3: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospijeca 4: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 2$ godine</p> <p>Razred dospijeca 5: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 3$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijeca m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq n$ godina</p>	<p>Smatra se da za valutne opcije bez isporuke (NDO) ne postoji likvidno tržište.</p>	

Razred imovine – valutne izvedenice			
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
<p>Valutne opcije s isporukom (DO)</p> <p>Opcija koja obuhvaća samo razmjenu dviju različitih valuta na određeni budući ugovoreni datum namire po fiksnoj stopi dogovorenoj pri sklapanju ugovora o razmjeni.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#26 = DLVB</p>	<p>podrazred valutna opcija s isporukom definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS23#13 i RTS23#47) – odnosni valutni par definiran je kao kombinacija dviju valuta koje su odnosni instrument ugovora o izvedenici</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeca opcije definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijeca 1: $0 < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 1$ tjedan</p> <p>Razred dospijeca 2: $1 \text{ tjedan} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 3$ mjeseca</p> <p>Razred dospijeca 3: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospijeca 4: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 2$ godine</p> <p>Razred dospijeca 5: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 3$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijeca m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq n$ godina</p>	<p>Smatra se da za valutne opcije s isporukom (DO) ne postoji likvidno tržište.</p>	

Razred imovine – valutne izvedenice			
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
<p>Valutni ugovori o razmjeni bez isporuke (NDS)</p> <p>Ugovor o razmjeni koji ugovorne strane, prema ugovornim uvjetima, namiruju u novcu, pri čemu se iznos za namiru utvrđuje na temelju razlike u tečaju dviju valuta na datum trgovanja i datum vrednovanja. Na datum namire jedna će strana drugoj strani dugovati neto razliku između i. tečaja na datum trgovanja i ii. tečaja na datum vrednovanja, na osnovi zamišljenog iznosa, i taj će se neto iznos isplatiti u valuti namire koja je utvrđena ugovorom.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = SWAP</p> <p>RTS2#26 = NDLV</p>	<p>podrazred valutni ugovori o razmjeni bez isporuke definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS23#13 i RTS23#47) – odnosni valutni par definiran je kao kombinacija dviju valuta koje su odnosni instrument ugovora o izvedenici</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijeća 1: $0 < \text{vrijeme do dospijeća} \leq 1$ tjedan</p> <p>Razred dospijeća 2: $1 \text{ tjedan} < \text{vrijeme do dospijeća} \leq 3$ mjeseca</p> <p>Razred dospijeća 3: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospijeća} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospijeća 4: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeća} \leq 2$ godine</p> <p>Razred dospijeća 5: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospijeća} \leq 3$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijeća m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeća} \leq n$ godina</p>	<p>Smatra se da za valutne ugovore o razmjeni bez isporuke ne postoji likvidno tržište.</p>	

Razred imovine – valutne izvedenice			
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
<p>Valutni ugovori o razmjeni s isporukom (DS)</p> <p>Ugovor o razmjeni koji obuhvaća samo razmjenu dviju različitih valuta na određeni budući ugovoreni datum namire po fiksnoj stopi dogovorenoj pri sklapanju ugovora o razmjeni.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = SWAP</p> <p>RTS2#26 = DLVB</p>	<p>Podrazred valutni ugovori o razmjeni s isporukom definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS23#13 i RTS23#47) – odnosni valutni par definiran je kao kombinacija dviju valuta koje su odnosni instrument ugovora o izvedenici</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeća ugovora o razmjeni definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijeća 1: $0 < \text{vrijeme do dospijeća} \leq 1$ tjedan</p> <p>Razred dospijeća 2: $1 \text{ tjedan} < \text{vrijeme do dospijeća} \leq 3$ mjeseca</p> <p>Razred dospijeća 3: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospijeća} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospijeća 4: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeća} \leq 2$ godine</p> <p>Razred dospijeća 5: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospijeća} \leq 3$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijeća m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeća} \leq n$ godina</p>	<p>Smatra se da za ostvarive valutne ugovore o razmjeni ne postoji likvidno tržište.</p>	

Razred imovine – valutne izvedenice			
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Valutne budućnosnice RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FUTR	Podrazred valutne budućnosnice definiran je sljedećim kriterijima segmentacije: Kriterij segmentacije 1 (RTS23#13 i RTS23#47) – odnosni valutni par definiran je kao kombinacija dviju valuta koje su odnosni instrument ugovora o izvedenici Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospjeća budućnosnice definirano je kako slijedi: Razred dospjeća 1: 0 < vrijeme do dospjeća ≤ 1 tjedan Razred dospjeća 2: 1 tjedan < vrijeme do dospjeća ≤ 3 mjeseca Razred dospjeća 3: 3 mjeseca < vrijeme do dospjeća ≤ 1 godina Razred dospjeća 4: 1 godina < vrijeme do dospjeća ≤ 2 godine Razred dospjeća 5: 2 godine < vrijeme do dospjeća ≤ 3 godine ... Razred dospjeća m: (n-1) godina < vrijeme do dospjeća ≤ n godina	Smatra se da za valutne budućnosnice ne postoji likvidno tržište.	
Razred imovine – valutne izvedenice			
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija		
Druge valutne izvedenice valutna izvedenica koja ne pripada ni u jedan od prethodno navedenih podrazreda imovine RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = OTHR	Smatra se da za sve druge valutne izvedenice ne postoji likvidno tržište.		

Tablica 8.2.

Valutne izvedenice – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – valutne izvedenice				
Podrazred imovine	Pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da ne postoji likvidno tržište			
	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
Terminski ugovor bez isporuke (NDF)	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Terminski ugovor s isporukom (DF)	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Valutne opcije bez isporuke (NDO)	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Valutne opcije s isporukom (DO)	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Valutni ugovori o razmjeni bez isporuke (NDS)	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Valutni ugovori o razmjeni s isporukom (DS)	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Valutne budućnosnice	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR
Druge valutne izvedenice	4 000 000 EUR	5 000 000 EUR	20 000 000 EUR	25 000 000 EUR

▼B

9. Kreditne izvedenice

▼M3

Tablica 9.1.

Kreditne izvedenice – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – kreditne izvedenice				
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Status indeksa <i>on-the-run</i> [Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti]
<p>Indeksni ugovor o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza (CDS) u kojem je razmjena novčanih tokova povezana s kreditnom sposobnosti nekoliko izdavatelja financijskih instrumenata koji čine indeks i nastankom kreditnih događaja</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT</p>	<p>Podrazred indeksni ugovori o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS2#34) – odnosni indeks</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#42) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa izvedenice</p> <p>Kriterij segmentacije 3 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijea CDS-a definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijea 1: $0 < \text{vrijeme do dospijea} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospijea 2: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 2$ godine</p> <p>Razred dospijea 3: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 3$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijea m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq n$ godina</p>	200 000 000 EUR	10	<p>Smatra se da za odnosni indeks postoji likvidno tržište.</p> <p>(1) tijekom cijelog razdoblja statusa <i>on-the-run</i></p> <p>(2) prvih 30 radnih dana statusa <i>1x off-the-run</i></p> <p>Status indeksa <i>on-the-run</i> označava najnoviju tekuću verziju (seriju) indeksa kreiranu na datum kad sastav indeksa počinje važiti, a koja završava na dan koji prethodi datumu kad sastav sljedeće verzije (serije) indeksa počinje važiti.</p> <p>Status <i>1x off-the-run</i> označava verziju (seriju) indeksa koja neposredno prethodi tekućoj <i>on-the-run</i> verziji (seriji) u određenom trenutku. Verzija (serija) prestaje imati status <i>on-the-run</i> te stječe status <i>1x off-the-run</i> nakon što se kreira posljednja verzija (serija) indeksa.</p>

Razred imovine – kreditne izvedenice				
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Status indeksa <i>on-the-run</i> [Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti]
<p>Ugovor o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza (CDS) jednog subjekta u kojem je razmjena novčanih tokova povezana s kreditnom sposobnosti jednog izdavatelja financijskih instrumenata i nastankom kreditnih događaja</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT</p>	<p>Podrazred ugovori o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza jednog subjekta definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS2#41) – odnosni referentni subjekt</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#39) – vrsta odnosnog referentnog subjekta definirana je kako slijedi:</p> <p>„Državni ili javni izdavatelj” znači jedan od sljedećih subjekata:</p> <p>(a) Unija;</p> <p>(b) država članica uključujući ministarstvo, agenciju ili subjekt posebne namjene države članice;</p> <p>(c) državni subjekt koji nije naveden u točkama (a) i (b);</p> <p>(d) u slučaju federalne države članice, član te federacije;</p> <p>(e) subjekt posebne namjene za nekoliko država članica;</p> <p>(f) međunarodna financijska institucija koju su osnovala dvije ili više država članica, čija je svrha mobilizirati sredstva i pružiti financijsku pomoć u korist svojih članova koji imaju ili im prijete ozbiljne financijske poteškoće;</p>	10 000 000 EUR	10	

Razred imovine – kreditne izvedenice				
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji		
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	Status indeksa <i>on-the-run</i> [Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti]
	<p>(g) Europska investicijska banka;</p> <p>(h) javno tijelo koje nije državni izdavatelj kako je navedeno u točkama (a) do (c).</p> <p>„Korporativni izdavatelj” znači subjekt koji je izdavatelj, ali koji nije državni ili javni izdavatelj.</p> <p>Kriterij segmentacije 3 (RTS2#42) – valuta zamišljenog iznosa definirana je kao valuta zamišljenog iznosa izvedenice</p> <p>Kriterij segmentacije 4 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijeca CDS-a definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijeca 1: $0 < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospijeca 2: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 2$ godine</p> <p>Razred dospijeca 3: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq 3$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijeca m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijeca} \leq n$ godina</p>			
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže sljedeće kvantitativne kriterije likvidnosti		
Opcija na indeks CDS-a je opcija čiji je odnosni instrument indeks CDS-ova	Podrazred opcija na indeks CDS-a definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:	Smatra se da likvidno tržište postoji za opciju na indeks CDS-a čiji je odnosni instrument indeks CDS-a koji se smatra podrazredom za koji je utvrđeno da likvidno tržište postoji i čije je vrijeme do razreda dospijeca od 0 do 6 mjeseci.		

Razred imovine – kreditne izvedenice			
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CRDT	<p>Kriterij segmentacije 1 (RTS23#26) – podrazred indeksa CDS-a kako je definirano za podrazred imovine indeksni ugovori o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza (CDS)</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospjeća opcije definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospjeća 1: $0 < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 6$ mjeseci</p> <p>Razred dospjeća 2: $6 \text{ mjeseci} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospjeća 3: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 2$ godine</p> <p>Razred dospjeća 4: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq 3$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospjeća m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospjeća} \leq n$ godina</p>	<p>Smatra se da likvidno tržište ne postoji za opciju na indeks CDS-a čiji je odnosni instrument indeks CDS-a koji se smatra podrazredom za koji je utvrđeno da likvidno tržište postoji i čije vrijeme do razreda dospjeća nije 0 do 6 mjeseci.</p> <p>Smatra se da likvidno tržište ne postoji za opciju na indeks CDS-a čiji je odnosni instrument indeks CDS-a koji se smatra podrazredom za koji je utvrđeno da likvidno tržište ne postoji u odnosu na bilo koji razred dospjeća.</p>	
<p>Opcija na CDS jednog subjekta je opcija čiji je odnosni instrument CDS jednog subjekta</p> <p>RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CRDT</p>	<p>podrazred opcije na CDS jednog subjekta definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS23#26) – podrazred CDS jednog subjekta kako je definirano za podrazred imovine CDS jednog subjekta</p>	<p>Smatra se da likvidno tržište postoji za opciju na CDS jednog subjekta čiji je odnosni instrument CDS jednog subjekta koji se smatra podrazredom za koji je utvrđeno da likvidno tržište postoji i čije vrijeme do razreda dospjeća od 0 do 6 mjeseci.</p> <p>Smatra se da likvidno tržište ne postoji za opciju na CDS jednog subjekta čiji je odnosni instrument CDS jednog subjekta koji se smatra podrazredom za koji je utvrđeno da likvidno tržište postoji i čije vrijeme do razreda dospjeća nije od 0 do 6 mjeseci.</p>	

Razred imovine – kreditne izvedenice			
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti Dodatni kvalitativni kriterij likvidnosti primjenjuje se, ovisno o slučaju, za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
	<p>Kriterij segmentacije 2 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijea opcije definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijea 1: $0 < \text{vrijeme do dospijea} \leq 6$ mjeseci</p> <p>Razred dospijea 2: $6 \text{ mjeseci} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospijea 3: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 2$ godine</p> <p>Razred dospijea 4: $2 \text{ godine} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 3$ godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijea m: $(n-1) \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq n$ godina</p>	Smatra se da likvidno tržište ne postoji za opciju na CDS jednog subjekta čiji je odnosni instrument CDS jednog subjekta koji se smatra podrazredom za koji je utvrđeno da likvidno tržište ne postoji u odnosu na bilo koji razred dospijea.	
Razred imovine – kreditne izvedenice			
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija		
<p>Druge kreditne izvedenice su kreditne izvedenice koje ne pripadaju ni u jedan od prethodno navedenih podrazreda imovine</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT RTS2#5 = OTHR</p>	Smatra se da za sve druge kreditne izvedenice ne postoji likvidno tržište.		

Tablica 9.2.

Kreditne izvedenice – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji

Razred imovine – kreditne izvedenice														
Podrazred imovine	Percentili i donji pragovi koji se primjenjuju za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji													
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja			LIS poslije trgovanja			
		Trgovanje – percentil				Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag
Indeksni ugovor o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunavanja obveza (CDS)	Pragovi se izračunavaju za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	2 500 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Ugovor o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunavanja obveza (CDS) jednog subjekta	Pragovi se izračunavaju za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	2 500 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									

Razred imovine – kreditne izvedenice														
Podrazred imovine	Percentili i donji pragovi koji se primjenjuju za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji													
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja			LIS poslije trgovanja			
		Trgovanje – percentil		Donji prag		Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	
Opcije na indeks CDS-ova	Pragovi se izračunavaju za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	2 500 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									
Opcije na CDS jednog subjekta	Pragovi se izračunavaju za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	2 500 000 EUR	70	5 000 000 EUR	80	60	7 500 000 EUR	90	70	10 000 000 EUR
		30	40	50	60									

Tablica 9.3.

Kreditne izvedenice – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – kreditne izvedenice				
Podrazred imovine	Pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da ne postoji likvidno tržište			
	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
Indeksni ugovor o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza (CDS)	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Ugovor o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza (CDS) jednog subjekta	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Opcije na indeks CDS-a	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Opcije na CDS jednog subjekta	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Druge kreditne izvedenice	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR

▼ B

10. C10 izvedenice

▼ M3

Tablica 10.1.

C10 izvedenice – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – C10 izvedenice			
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
<p>Izvedenice koje se odnose na vozarine Financijski instrument koji se odnosi na vozarine kako je definirano u odjeljku C točki 10. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = COMM i RTS23#35 = FRGT</p>	<p>Podrazred izvedenica koje se odnose na vozarine definiran je sljedećim kriterijima segmentacije:</p> <p>Kriterij segmentacije 1 (RTS2#5) – vrsta ugovora: budućnosnice ili opcije</p> <p>Kriterij segmentacije 2 (RTS23#36) – vrsta tereta</p> <p>Kriterij segmentacije 3 (RTS2#37) – podvrsta tereta</p> <p>Kriterij segmentacije 4 (RTS2#12) – naznaka veličine koja se odnosi na podvrstu tereta</p> <p>Kriterij segmentacije 5 (RTS2#13) – određena linija ili zakup na određeno vrijeme</p> <p>Kriterij segmentacije 6 (RTS2#8) – vrijeme do razreda dospijea izvedenice definirano je kako slijedi:</p> <p>Razred dospijea 1: $0 < \text{vrijeme do dospijea} \leq 1$ mjesec</p> <p>Razred dospijea 2: $1 \text{ mjesec} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 3$ mjeseca</p> <p>Razred dospijea 3: $3 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 6$ mjeseci</p> <p>Razred dospijea 4: $6 \text{ mjeseci} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 9$ mjeseci</p> <p>Razred dospijea 5: $9 \text{ mjeseca} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 1$ godina</p> <p>Razred dospijea 6: $1 \text{ godina} < \text{vrijeme do dospijea} \leq 2$ godine</p>	10 000 000 EUR	10

Razred imovine – C10 izvedenice			
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
		Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
	<p>Razred dospijeca 7: 2 godine < vrijeme do dospijeca ≤ 3 godine</p> <p>...</p> <p>Razred dospijeca m: (n-1) godina < vrijeme do dospijeca ≤ n godina</p>		
Razred imovine – C10 izvedenice			
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija		
<p>Druge C10 izvedenice</p> <p>Financijski instrument kako je definiran u odjeljku C točki 10. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU koji nije „izvedenica koja se odnosi na vozarine“, jedan od sljedećih podrazreda imovine kamatnih izvedenica: inflacijski viševalutni ili međuvalutni ugovor o razmjeni, budućnosnica/terminski ugovor koji se odnose na inflacijske viševalutne ili međuvalutne ugovore o razmjeni, inflacijski jednovalutni ugovori o razmjeni, budućnosnica/terminski ugovor koji se odnose na inflacijske jednovalutne ugovore o razmjeni i jedan od sljedećih podrazreda imovine vlasničkih izvedenica: opcija na indeks volatilnosti, budućnosnica/terminski ugovor koji se odnosi na indeks volatilnosti, ugovori o razmjeni s rezultatom na osnovi varijance, ugovori o razmjeni s rezultatom na osnovi volatilnosti, ugovori o razmjeni na razini portfelja s rezultatom na osnovi varijance, ugovori o razmjeni na razini portfelja s rezultatom na osnovi volatilnosti</p>	Smatra se da za sve druge C10 izvedenice ne postoji likvidno tržište.		

Tablica 10.2.

C10 izvedenice – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji

Razred imovine – C10 izvedenice														
Podrazred imovine	Percentili i donji pragovi koje treba primijeniti za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji													
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja			LIS poslije trgovanja			
		Trgovanje – percentil				Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag
Izvedenice koje se odnose na vozarine	izračun pragova trebalo bi provesti za svaki podrazred odgovarajućeg podrazreda imovine uzimajući u obzir transakcije izvršene s financijskim instrumentima koji pripadaju u taj podrazred	S1	S2	S3	S4	25 000 EUR	70	50 000 EUR	80	60	75 000 EUR	90	70	100 000 EUR
		30	40	50	60									

Tablica 10.3.

C10 izvedenice – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – C10 izvedenice				
Podrazred imovine	Pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da ne postoji likvidno tržište			
	SSTI prije trgovanja		LIS prije trgovanja	
	Granična vrijednost		Granična vrijednost	
Izvedenice koje se odnose na vozarine	25 000 EUR		50 000 EUR	
Druge C10 izvedenice	25 000 EUR		50 000 EUR	

▼B

11. Financijski ugovori za razlike (CFD)

▼M3

Tablica 11.1.

CFD-i – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda financijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Kvalitativni kriterij likvidnosti	Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Valutni CFD-i RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = CURR	Podrazred valutni CFD definiran je kao odnosni valutni par definiran kao kombinacija dviju valuta koje su odnosni instrument CFD-a/ugovora o okladama na raspone RTS2#30 i RTS2#31		50 000 000 EUR	100
Roba CFD-i RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = COMM	Podrazred robni CFD-i definiran je kao odnosna roba CFD-a/ugovora o okladama na raspone RTS23#35 i RTS23#36 i RTS23#37		50 000 000 EUR	100
Vlasnički CFD-i RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = EQUI	Podrazred vlasnički CFD-i definiran je kao odnosni vlasnički vrijednosni papir CFD-a/ugovora o okladama na raspone RTS23#26	Smatra se da za podrazred vlasnički CFD-i postoji likvidno tržište ako je odnosni instrument vlasnički vrijednosni papir za koji postoji likvidno tržište kako je utvrđeno u skladu s člankom 2. stavkom 1. točkom 17. podtočkom (b) Uredbe (EU) br. 600/2014		
CFD-i koji se odnose na obveznice RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = BOND	Podrazred CFD-i koji se odnose na obveznice definiran je kao odnosna obveznica ili obveznička budućnosnica za CFD-e/ugovore o okladama na raspone RTS23#26	Smatra se da za podrazred CFD-i koji se odnose na obveznice postoji likvidno tržište ako je odnosni instrument obveznica ili obveznička budućnosnica za koji postoji likvidno tržište kako je utvrđeno u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b).		

▼ M3

Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da likvidno tržište ne postoji u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b), svaki podrazred imovine dodatno se segmentira u podrazrede kako je definirano u nastavku	Kvalitativni kriterij likvidnosti	Prosječni dnevni zamišljeni iznos (ADNA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
CFD-i koji se odnose na vlasničke budućnosnice/ terminske ugovore RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = FTEQ	Podrazred CFD-i koji se odnose na vlasničke budućnosnice/ terminske ugovore definiran je kao odnosna budućnosnica/ terminski ugovor koji se odnosi na vlasnički vrijednosni papir za CFD-e/ugovore o okladama na raspone RTS23#26	Smatra se da za podrazred CFD-i koji se odnose na vlasničke budućnosnice/ terminske ugovore postoji likvidno tržište ako je odnosni instrument vlasnička budućnosnica/terminski ugovor za koji postoji likvidno tržište kako je utvrđeno u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b).		
CFD-i koji se odnose na vlasničke opcije RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OPEQ	Podrazred CFD-i koji se odnose na vlasničke opcije definiran je kao odnosna opcija na vlasnički vrijednosni papir za CFD-e/ugovore o okladama na raspone RTS23#26	Smatra se da za podrazred CFD-i koji se odnose na vlasničke opcije postoji likvidno tržište ako je odnosni instrument vlasnička opcija za koji postoji likvidno tržište kako je utvrđeno u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b).		
Razred imovine – finansijski ugovori za razlike (CFD)				
Podrazred imovine	Za potrebe utvrđivanja razreda finansijskih instrumenata za koje se smatra da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) primjenjuje se sljedeća metodologija			
Drugi CFD-i				
CFD/ugovor o okladama na raspone koji ne pripada ni u jedan od prethodno navedenih podrazreda imovine RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OTHR	Smatra se da za sve druge CFD-e/ugovore o okladama na raspone ne postoji likvidno tržište.			

Tablica 11.2.

CFD-ovi – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji

Razred imovine – financijski ugovori za razlike (CFD)														
Podrazred imovine	Percentili i donji pragovi koje treba primijeniti za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji													
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja			LIS poslije trgovanja			
		Trgovanje – percentil				Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag
Valutni CFD-ovi	transakcije izvršene s valutnim CFD-ovima za koje se smatra da postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b)	S1	S2	S3	S4	50 000 EUR	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
		30	40	50	60									
Robni CFD-ovi	transakcije izvršene s robnim CFD-ovima za koje se smatra da postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b)	S1	S2	S3	S4	50 000 EUR	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
		30	40	50	60									
Vlasnički CFD-ovi	transakcije izvršene s vlasničkim CFD-ovima za koje se smatra da postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b)	S1	S2	S3	S4	50 000 EUR	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
		30	40	50	60									

Razred imovine – financijski ugovori za razlike (CFD)														
Podrazred imovine	Percentili i donji pragovi koje treba primijeniti za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji													
	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračune pragova	SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja			LIS poslije trgovanja			
		Trgovanje – percentil		Donji prag		Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Volumen – percentil	Donji prag	
CFD-ovi koji se odnose na obveznice	transakcije izvršene s CFD-ovima koji se odnose na obveznice za koje se smatra da postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b)	S1	S2	S3	S4	50 000 EUR	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
		30	40	50	60									
CFD-ovi koji se odnose na vlasničke budućnosnice/terminske ugovore	transakcije izvršene s CFD-ovima koji se odnose na vlasničke budućnosnice za koje se smatra da postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b)	S1	S2	S3	S4	50 000 EUR	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
		30	40	50	60									
CFD-ovi koji se odnose na vlasničke opcije	transakcije izvršene s CFD-ovima koji se odnose na vlasničke opcije za koje se smatra da postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b)	S1	S2	S3	S4	50 000 EUR	70	60 000 EUR	80	60	90 000 EUR	90	70	100 000 EUR
		30	40	50	60									

Tablica 11.3.

CFD-ovi – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište postoji

Razred imovine – financijski ugovori za razlike (CFD)				
Podrazred imovine	Pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da likvidno tržište ne postoji			
	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
	Grafična vrijednost	Grafična vrijednost	Grafična vrijednost	Grafična vrijednost
Valutni CFD-ovi	50 000 EUR	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Robni CFD-ovi	50 000 EUR	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Vlasnički CFD-ovi	50 000 EUR	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
CFD-ovi koji se odnose na obveznice	50 000 EUR	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
CFD-ovi koji se odnose na vlasničke budućnosnice/terminske ugovore	50 000 EUR	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
CFD-ovi koji se odnose na vlasničke opcije	50 000 EUR	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR
Drugi CFD-ovi/ugovori o okladama na raspone	50 000 EUR	60 000 EUR	90 000 EUR	100 000 EUR

▼B

12. Emisijske jedinice

▼M3

Tablica 12.1.

Emisijske jedinice – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – emisijske jedinice		
Podrazred imovine	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
	Prosječni dnevni iznos (ADA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
<p>Emisijske jedinice Europske unije (EUA)</p> <p>Svaka jedinica kojoj se priznaje usklađenost sa zahtjevima Direktive 2003/87/EZ Europskog parlamenta i Vijeća ⁽¹⁾ (sustav trgovanja emisijskim jedinicama) koja označava pravo na emisiju jedne tone ekvivalenta ugljikovog dioksida (tCO₂e)</p> <p>RTS2#3 = EMAL i RTS2#11 = EUAE</p>	150 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	5
<p>Zrakoplovne emisijske jedinice Europske unije (EUAA)</p> <p>Svaka jedinica kojoj se priznaje usklađenost sa zahtjevima Direktive 2003/87/EZ (sustav trgovanja emisijskim jedinicama) koja označava pravo na emisiju jedne tone ekvivalenta ugljikovog dioksida (tCO₂e) iz zrakoplovstva</p> <p>RTS2#3 = EMAL i RTS2#11 = EUAA</p>	150 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	5
<p>Ovjerena smanjenja emisije (CER)</p> <p>Svaka jedinica kojoj se priznaje usklađenost sa zahtjevima Direktive 2003/87/EZ (sustav trgovanja emisijskim jedinicama) koja označava smanjenje emisije za jednu tonu ekvivalenta ugljikovog dioksida (tCO₂e)</p> <p>RTS2#3 = EMAL i RTS2#11 = CERE</p>	150 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	5

Razred imovine – emisijske jedinice		
Podrazred imovine	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
	Prosječni dnevni iznos (ADA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Jedinice smanjenja emisije (ERU) Svaka jedinica kojoj se priznaje usklađenost sa zahtjevima Direktive 2003/87/EZ (sustav trgovanja emisijskim jedinicama) koja označava smanjenje emisije za jednu tonu ekvivalenta ugljikovog dioksida (tCO ₂ e) RTS2#3 = EMAL i RTS2#11 = ERUE	150 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	5
Druge emisijske jedinice Emisijske jedinice kojima se priznaje usklađenost sa zahtjevima Direktive 2003/87/EZ (sustav trgovanja emisijskim jedinicama), a ne emisijske jedinice Europske unije (EUA), zrakoplovne emisijske jedinice Europske unije (EUAA), ovjerena smanjenja emisije (CER) ili jedinice smanjenja emisija (ERU) RTS2#3 = EMAL i RTS2#11 = OTHR	Smatra se da za druge izvedenice na emisijske jedinice ne postoji likvidno tržište.	
<small>(¹) Direktiva 2003/87/EZ Europskog parlamenta i Vijeća od 13. listopada 2003. o uspostavi sustava trgovanja emisijskim jedinicama stakleničkih plinova unutar Zajednice i o izmjeni Direktive Vijeća 96/61/EZ (SL L 275, 25.10.2003., str. 32.).</small>		

Tablica 12.2.

Emisijske jedinice – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede imovine za koje je utvrđeno da postoji likvidno tržište

Razred imovine – emisijske jedinice												
Podrazred imovine	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova	Percentili i donji pragovi koje treba primijeniti za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede imovine za koje je utvrđeno da postoji likvidno tržište										
		SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja		LIS poslije trgovanja		
		Trgovanje – percentil		Donji prag		Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	
Emisijske jedinice Europske unije (EUA)	transakcije izvršene sa svim emisijskim jedinicama Europske unije (EUA)	S1	S2	S3	S4	40 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	70	50 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	80	90 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	90	100 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida
		30	40	50	60							
Zrakoplovne emisijske jedinice Europske unije (EUAA)	transakcije izvršene sa svim zrakoplovnim emisijskim jedinicama Europske unije (EUAA)	S1	S2	S3	S4	20 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	70	25 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	80	40 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	90	50 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida
		30	40	50	60							
Ovjerena smanjenja emisije (CER)	transakcije izvršene sa svim ovjerenim smanjenjima emisija (CER)	S1	S2	S3	S4	20 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	70	25 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	80	40 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	90	50 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida
		30	40	50	60							
Jedinice smanjenja emisije (ERU)	transakcije izvršene sa svim jedinicama smanjenja emisija (ERU)	S1	S2	S3	S4	20 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	70	25 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	80	40 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	90	50 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida
		30	40	50	60							

▼ **B**

Tablica 12.3.

Emisijske jedinice – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede imovine za koje je utvrđeno da ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – emisijske jedinice				
Podrazred imovine	Pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i za veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede za koje je utvrđeno da ne postoji likvidno tržište			
	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
Emisijske jedinice Europske unije (EUA)	40 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	50 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	90 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	100 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida
Zrakoplovne emisijske jedinice Europske unije (EUAA)	20 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	25 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	40 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	50 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida
Ovjerena smanjenja emisije (CER)	20 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	25 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	40 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	50 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida
Jedinice smanjenja emisije (ERU)	20 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	25 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	40 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	50 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida

13. Izvedenice emisijskih jedinica

▼ **M3**

Tablica 13.1.

Izvedenice na emisijske jedinice – razredi za koje ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – izvedenice na emisijske jedinice		
Podrazred imovine	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti	
	Prosječni dnevni iznos (ADA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]
Izvedenice na emisijske jedinice koje kao odnosni instrument imaju emisijske jedinice Europske unije (EUA) Financijski instrument koji se odnosi na emisijske jedinice Europske unije (EUA) kako je definirano u odjeljku C točki 4. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = EMAL i RTS2#43 = EUAE	150 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	5

		Razred imovine – izvedenice na emisijske jedinice	
Podrazred imovine	Za svaki se podrazred utvrđuje da ne postoji likvidno tržište u skladu s člankom 6. i člankom 8. stavkom 1. točkom (b) ako ne doseže jedan ili ni jedan od sljedećih pragova kvantitativnih kriterija likvidnosti		
	Prosječni dnevni iznos (ADA) [kvantitativni kriterij likvidnosti 1]	Prosječni dnevni broj transakcija [kvantitativni kriterij likvidnosti 2]	
<p>Izvedenice na emisijske jedinice koje kao odnosni instrument imaju zrakoplovne emisijske jedinice Europske unije (EUAA)</p> <p>Financijski instrument koji se odnosi na zrakoplovne emisijske jedinice Europske unije (EUAA) kako je definirano u odjeljku C točki 4. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU</p> <p>RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = EMAL i RTS2#43 = EUAA</p>	150 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	5	
<p>Izvedenice na emisijske jedinice koje kao odnosni instrument imaju ovjerena smanjenja emisija (CER)</p> <p>Financijski instrument koji se odnosi na emisijske jedinice – ovjerena smanjenja emisija (CER) kako je definirano u odjeljku C točki 4. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU</p> <p>RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = EMAL i RTS2#43 = CERE</p>	150 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	5	
<p>Izvedenice na emisijske jedinice koje kao odnosni instrument imaju jedinice smanjenja emisija (ERU)</p> <p>Financijski instrument koji se odnosi na jedinice smanjenja emisija kako je definirano u odjeljku C točki 4. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU</p> <p>RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = EMAL i RTS2#43 = ERUE</p>	150 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	5	
<p>Ostale izvedenice na emisijske jedinice</p> <p>izvedenica na emisijske jedinice koja kao odnosni instrument ima emisijske jedinice kojima se priznaje usklađenost sa zahtjevima Direktive 2003/87/EZ (sustav trgovanja emisijskim jedinicama), a ne emisijske jedinice Europske unije (EUA), zrakoplovne emisijske jedinice Europske unije (EUAA), ovjerena smanjenja emisije (CER) i jedinice smanjenja emisija (ERU)</p> <p>RTS2#3 = DERV i RTS2#4 = EMAL i RTS2#43 = OTHR</p>	Smatra se da za druge izvedenice na emisijske jedinice ne postoji likvidno tržište.		

Tablica 13.2.

Izvedenice emisijskih jedinica – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede imovine za koje je utvrđeno da postoji likvidno tržište

Razred imovine – izvedenice emisijskih jedinica												
Podrazred imovine	Transakcije koje se uzimaju u obzir za izračun pragova	Percentili i donji pragovi koje treba primijeniti za izračun pragova za SSTI i LIS prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede imovine za koje je utvrđeno da postoji likvidno tržište										
		SSTI prije trgovanja				LIS prije trgovanja		SSTI poslije trgovanja		LIS poslije trgovanja		
		Trgovanje – percentil		Donji prag		Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	Trgovanje – percentil	Donji prag	
Izvedenice emisijskih jedinica koje kao odnosni instrument imaju emisijske jedinice Europske unije (EUA)	transakcije izvršene sa svim izvedenicama emisijskih jedinica koje kao odnosni instrument imaju emisijske jedinice Europske unije (EUA)	S1	S2	S3	S4	40 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	70	50 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	80	90 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	90	100 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida
		30	40	50	60							
Izvedenice emisijskih jedinica koje kao odnosni instrument imaju zrakoplovne emisijske jedinice Europske unije (EUAA)	transakcije izvršene sa svim izvedenicama emisijskih jedinica koje kao odnosni instrument imaju zrakoplovne emisijske jedinice Europske unije (EUAA)	S1	S2	S3	S4	20 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	70	25 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	80	40 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	90	50 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida
		30	40	50	60							
Izvedenice emisijskih jedinica koje kao odnosni instrument imaju ovjerena smanjenja emisija (CER)	transakcije izvršene sa svim izvedenicama emisijskih jedinica koje kao odnosni instrument imaju ovjerena smanjenja emisija (CER)	S1	S2	S3	S4	20 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	70	25 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	80	40 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	90	50 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida
		30	40	50	60							
Izvedenice emisijskih jedinica koje kao odnosni instrument imaju jedinice smanjenja emisija (ERU)	transakcije izvršene sa svim izvedenicama emisijskih jedinica koje kao odnosni instrument imaju jedinice smanjenja emisija (ERU)	S1	S2	S3	S4	20 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	70	25 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	80	40 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	90	50 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida
		30	40	50	60							

Tablica 13.3.

Izvedenice emisijskih jedinica – pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede imovine za koje je utvrđeno da ne postoji likvidno tržište

Razred imovine – izvedenice emisijskih jedinica				
Podrazred imovine	Pragovi za veličinu karakterističnu za instrument (SSTI) i veliki tržišni obujam (LIS) prije trgovanja i poslije trgovanja za podrazrede imovine za koje je utvrđeno da ne postoji likvidno tržište			
	SSTI prije trgovanja	LIS prije trgovanja	SSTI poslije trgovanja	LIS poslije trgovanja
	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost	Granična vrijednost
Izvedenice emisijskih jedinica koje kao odnosni instrument imaju emisijske jedinice Europske unije (EUA)	40 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	50 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	90 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	100 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida
Izvedenice emisijskih jedinica koje kao odnosni instrument imaju zrakoplovne emisijske jedinice Europske unije (EUAA)	20 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	25 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	40 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	50 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida
Izvedenice emisijskih jedinica koje kao odnosni instrument imaju ovjerena smanjenja emisija (CER)	20 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	25 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	40 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	50 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida
Izvedenice emisijskih jedinica koje kao odnosni instrument imaju jedinice smanjenja emisija (ERU)	20 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	25 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	40 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	50 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida
Ostale izvedenice emisijskih jedinica	20 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	25 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	40 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida	50 000 tona ekvivalenta ugljikovog dioksida



PRILOG IV.

Referentni podaci koji se dostavljaju za potrebe izračuna povezanih s transparentnosti

Tablica 1.

Tablica s oznakama za tablicu 2.

SIMBOL	VRSTA PODATKA	DEFINICIJA
{ALPHANUM-n}	Do n alfanumeričkih znakova	Rubrika za slobodan unos teksta.
{DECIMAL-n/m}	Decimalni broj od ukupno najviše n znamenki od kojih najviše m znamenki može biti dio decimalne	Numeričko polje za pozitivne i negativne vrijednosti. — decimalni razdjelnik je „.” (točka), — ispred broja je moguće staviti „-” (minus) za označavanje negativnih brojeva. Vrijednosti se, prema potrebi, zaokružuju, a ne skraćuju.
{COUNTRYCODE_2}	2 alfanumerička znaka	Dvoslovnna oznaka države, kako je definirano u alpha-2 kodu države u skladu s normom ISO 3166-1
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerička znaka	Troslovnna oznaka države, kako je definirano u valutnim oznakama u skladu s normom ISO 4217
{DATEFORMAT}	Format datuma u skladu s normom ISO 8601	Datumi bi se trebali navoditi u sljedećem formatu: GGGG-MM-DD.
{ISIN}	12 alfanumerička znaka	Oznaka ISIN, kako je definirano u normi ISO 6166
{LEI}	20 alfanumerička znaka	Identifikator pravne osobe, kako je definirano u normi ISO 17442.
{MIC}	4 alfanumerička znaka	Identifikacijska oznaka tržišta, kako je definirano u normi ISO 10383
{INDEX}	4 alfanumerička znaka	„EONA” – EONIA „EONS” – EONIA SWAP „EURI” – EURIBOR „EUUS” – EURODOLLAR „EUCH” – EuroSwiss „GCFR” – GCF REPO „ISDA” – ISDAFIX „LIBI” – LIBID „LIBO” – LIBOR „MAAA” – Muni AAA „PFAN” – Pfandbriefe „TIBO” – TIBOR „STBO” – STIBOR „BBSW” – BBSW „JIBA” – JIBAR „BUBO” – BUBOR „CDOR” – CDOR „CIBO” – CIBOR „MOSP” – MOSPRIM

▼ B

SIMBOL	VRSTA PODATKA	DEFINICIJA
		„NIBO” – NIBOR „PRBO” – PRIBOR „TLBO” – TELBOR „WIBO” – WIBOR „TREA” – Riznica „SWAP” – Ugovor o razmjeni „FUSW” – Terminski ugovor o razmjeni

Tablica 2.

Pojediniosti o referentnim podacima koji se dostavljaju za potrebe izračuna povezanih s transparentnošću

#	RUBRIKA	POJEDINOSTI O KOJIMA SE IZVJEŠĆUJE	FORMAT ZA IZVJEŠĆIVANJE
1	Identifikacijska oznaka instrumenta	Oznaka koja se upotrebljava za identifikaciju financijskog instrumenta	{ISIN}
2	Puni naziv instrumenta	Puni naziv financijskog instrumenta	{ALPHANUM-350}
3	Identifikator MiFIR	<p>Identifikacija nevlasničkih financijskih instrumenata</p> <p>Sekuritizirane izvedenice kako je definirano u odjeljku 4. tablici 4.1. Priloga III.</p> <p>Strukturirani financijski proizvodi kako je definirano u članku 2. stavku 1. točki 28. Uredbe (EU) br. 600/2014</p> <p>Obveznice (za sve obveznice osim robe kojom se trguje na burzi (ETC) i dužničkih instrumenata kojima se trguje na burzi (ETN)) kako je definirano u članku 4. stavku 1. točki 44. podtočki (b) Direktive 2014/65/EU</p> <p>Roba kojom se trguje na burzi (ETC) kako je definirano u članku 4. stavku 1. točki 44. podtočki (b) Direktive 2014/65/EU i dodatno utvrđeno u odjeljku 2. tablici 2.4. Priloga III.</p> <p>Dužnički instrumenti kojima se trguje na burzi (ETC) kako je definirano u članku 4. stavku 1. točki 44. podtočki (b) Direktive 2014/65/EU i dodatno utvrđeno u odjeljku 2. tablici 2.4. Priloga III.</p> <p>Emisijske jedinice kako je definirano u odjeljku 12. tablici 12.1. Priloga III.</p> <p>Izvedenice kako je definirano u odjeljku C točkama 4. do 10. Priloga I. Direktivi 2014/65/EU;</p>	<p>Nevasnički financijski instrumenti:</p> <p>„SDRV” – sekuritizirane izvedenice</p> <p>„SFPS” – strukturirani financijski proizvodi (SFP)</p> <p>„BOND” – obveznice</p> <p>„ETCS” – roba kojom se trguje na burzi (ETC)</p> <p>„ETNS” – dužnički instrumenti kojima se trguje na burzi (ETN)</p> <p>„EMAL” – emisijske jedinice</p> <p>„DERV” – izvedenice</p>
4	Razred imovine odnosno instrumenta	Popunjava se kad je identifikator MiFIR sekuritizirana izvedenica ili izvedenica.	<p>„INTR” – kamatna stopa</p> <p>„EQUI” – vlasnički vrijednosni papir</p> <p>„COMM” – roba</p>

▼ **B**

#	RUBRIKA	POJEDINOSTI O KOJIMA SE IZVJEŠĆUJE	FORMAT ZA IZVJEŠĆIVANJE
			„CRDT” – kredit „CURR” – valuta „EMAL” – emisijske jedinice
5	Vrsta ugovora	Popunjava se kad je identifikator MiFIR izvedenica.	„OPTN” – opcije „FUTR” – budućnosnice „FRAS” – terminski ugovor o stopama „FORW” – terminski ugovori „SWAP” – ugovori o razmjeni „PSWP” – ugovori o razmjeni na razini portfelja „SWPT” – opcije razmjene „FONS” – budućnosnice koje se odnose na ugovore o razmjeni „FWOS” – terminski ugovori koji se odnose na ugovore o razmjeni „FRAS” – terminski ugovori koji se odnose na vozarine „SPDB” – oklade na raspone „CFDS” – CFD „OTHR” – ostalo
6	Datum izvješćivanja	Datum kad se dostavljaju referentni podaci	{DATEFORMAT}
7	Mjesto trgovanja	MIC segmenta za mjesto trgovanja ako je dostupan, u protivnom operativni MIC.	{MIC}
8	Dospijeće	Dospijeće financijskog instrumenta. Ova se rubrika primjenjuje na razrede imovine: obveznice, kamatne izvedenice, vlasničke izvedenice, robne izvedenice, valutne izvedenice, kreditne izvedenice, C10 izvedenice i izvedenice emisijskih jedinica.	{DATEFORMAT}

Rubrike koje se odnose na obveznice (sve vrste obveznica osim ETC-ova i ETN-ova)

9	Vrsta obveznice	Vrsta obveznice kako je utvrđeno u odjeljku 2. tablici 2.2. Priloga III. Rubrika se popunjava kad su obveznice identifikator MiFIR.	„EUSB” – državne obveznice „OEPB” – druge javne obveznice „CVTB” – konvertibilne obveznice „CVDB” – pokrivene obveznice „CRPB” – korporativne obveznice „OTHR” – ostalo
10	Datum izdavanja	Datum izdavanja obveznice i početak obračunavanja kamate.	{DATEFORMAT}

▼ **B**

#	RUBRIKA	POJEDINOSTI O KOJIMA SE IZVJEŠĆUJE	FORMAT ZA IZVJEŠĆIVANJE
---	---------	------------------------------------	-------------------------

Rubrike koje se odnose na emisijske jedinice

Rubrike u ovom odjeljku popunjavaju se samo za emisijske jedinice kako je definirano u odjeljku 12. tablici 12.1. Priloga III.

11	Podvrsta emisijskih jedinica	Emisijske jedinice	„CERE” – CER „ERUE” – ERU „EUAE” – EUA „EUAA” – EUAA
----	------------------------------	--------------------	---

Rubrike koje se odnose na izvedenice**Robne izvedenice i C10 izvedenice**

12	Naznaka veličine koja se odnosi na podvrstu tereta	Rubrika se popunjava ako je teret osnovni proizvod utvrđen u rubrici 35 u tablici 2. Priloga Delegiranoj uredbi Komisije (EU) 2017/585.	{ALPHANUM-25}
13	Određena linija ili prosječni zakup na određeno vrijeme	Rubrika se popunjava ako je teret osnovni proizvod utvrđen u rubrici 35 u tablici 2. Priloga Delegiranoj uredbi Komisije (EU) 2017/585.	{ALPHANUM-25}
14	Mjesto isporuke/namire u novcu	Rubrika se popunjava ako je energent osnovni proizvod utvrđen u rubrici 35 u tablici 2 Priloga Delegiranoj uredbi Komisije (EU) 2017/585.	{ALPHANUM-25}
15	Valuta zamišljene vrijednosti	Valuta u kojoj je zamišljena vrijednost denominirana.	{CURRENCYCODE_3}

Kamatne izvedenice

Rubrike u ovom odjeljku popunjavaju se samo za kamatne izvedenice kako je definirano u odjeljku 5. tablici 5.1. Priloga III.

16	Vrsta odnosnog instrumenta	Za vrste ugovora osim ugovora o razmjeni, opcija razmjene, budućnosnica koje se odnose na ugovore o razmjeni i terminskih ugovora koji se odnose na ugovore o razmjeni rubrike se popunjavaju sljedećim mogućnostima Za vrste ugovora koji su ugovori o razmjeni, opcije razmjene, budućnosnice koje se odnose na ugovore o razmjeni i terminski ugovori koji se odnose na ugovore o razmjeni u pogledu odnosnog ugovora o razmjeni rubrike se popunjavaju sljedećim mogućnostima	„BOND” – obveznice „BNDF” – budućnosnice koje se odnose na obveznice „INTR” – kamatna stopa „IFUT” – budućnosnice koje se odnose na kamatne stope – FRA „FFMC” – VIŠEVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI PROMJENJIVE ZA PROMJENJIVU KAMATNU STOPU „XFMC” – VIŠEVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI FIKSNE ZA PROMJENJIVU KAMATNU STOPU „XXMC” – VIŠEVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI FIKSNE ZA FIKSNU KAMATNU STOPU „OSMC” – PREKONOĆNI KAMATNI VIŠEVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI
----	----------------------------	--	---

▼ B

#	RUBRIKA	POJEDINOSTI O KOJIMA SE IZVJEŠĆUJE	FORMAT ZA IZVJEŠĆIVANJE
			<p>„IFMC” – INFLACIJSKI VIŠEVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI</p> <p>„FFSC” – JEDNOVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI PROMJENJIVE ZA PROMJENJIVU KAMATNU STOPU</p> <p>„XFSC” – JEDNOVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI FIKSNE ZA PROMJENJIVU KAMATNU STOPU</p> <p>„XXSC” – JEDNOVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI FIKSNE ZA FIKSNU KAMATNU STOPU</p> <p>„OSSC” – PREKONOČNI KAMATNI JEDNOVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI</p> <p>„IFSC” – INFLACIJSKI JEDNOVALUTNI UGOVORI O RAZMJENI</p>
17	Izdavatelj odnosne obveznice	Kad je odnosni instrument obveznica ili budućnosca koja se odnosi na obveznicu u rubrici se navodi oznaka identifikatora pravnog subjekta (LEI) izdavatelja izravne ili krajnje odnosne obveznice.	{LEI}
18	Datum dospijea odnosne obveznice	U rubrici se navodi datum dospijea odnosne obveznice. Rubrika se odnosi na dužničke instrumente s utvrđenim dospijecom.	{DATEFORMAT}
19	Datum izdavanja odnosne obveznice	U rubrici se navodi datum izdavanja odnosne obveznice.	{DATEFORMAT}
20	Valuta zamišljene vrijednosti opcije razmjene	Rubrika se popunjava za opcije razmjene.	{CURRENCYCODE_3}
21	Dospijee odnosnog ugovora o razmjeni	Rubrika se popunjava samo za opcije razmjene, budućnosnice/terminske ugovore koji se odnose na ugovore o razmjeni.	{DATEFORMAT}
22	Oznaka ISIN inflacijskog indeksa	U slučaju opcija razmjene na jednu od sljedećih vrsta odnosnih ugovora o razmjeni: inflacijski jednovalutni ugovor o razmjeni, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na inflacijski jednovalutni ugovor o razmjeni, inflacijski viševalutni ugovor o razmjeni, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na inflacijski viševalutni ugovor o razmjeni; kad inflacijski indeks ima ISIN, u rubrici se mora navesti oznaka ISIN tog indeksa.	{ISIN}

▼ **B**

#	RUBRIKA	POJEDINOSTI O KOJIMA SE IZVJEŠĆUJE	FORMAT ZA IZVJEŠĆIVANJE
23	Naziv inflacijskog indeksa	U rubrici se navodi standardizirani naziv indeksa u slučaju opcija razmjene na jednu od sljedećih vrsta odnosnih ugovora o razmjeni: inflacijski jednovalutni ugovor o razmjeni, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na inflacijski jednovalutni ugovor o razmjeni, inflacijski viševalutni ugovor o razmjeni, budućnosnice/terminski ugovori koji se odnose na inflacijski viševalutni ugovor o razmjeni;	{ALPHANUM-25}
24	Referentna stopa	Naziv referentne stope.	{INDEX} ili {ALPHANUM-25} – ako referentna stopa nije uvrštena u popis {INDEX}
25	Rok ugovora o kamatnoj stopi	U ovoj se rubrici navodi rok ugovora. Rok se izražava u danima, tjednima, mjesecima ili godinama.	{INTEGER-3}+ „DAYS” – dani {INTEGER-3}+ „WEEK” – tjedni {INTEGER-3}+ „MNTH” – mjeseci {INTEGER-3}+ „YEAR” – godine

Valutne izvedenice

Rubrike u ovom odjeljku popunjavaju se samo za valutne izvedenice kako je definirano u odjeljku 8. tablici 8.1. Priloga III.

26	Podvrsta ugovora	Rubrika se popunjava kako bi se razlikovali terminski ugovori, opcije i opcije razmjene s isporukom i bez isporuke kako je definirano u odjeljku 8. tablici 8.1. Priloga III.	„DLVB” – s isporukom „NDLV” – bez isporuke
----	------------------	---	---

Vlasničke izvedenice

Rubrike u ovom odjeljku popunjavaju se samo za vlasničke izvedenice kako je definirano u odjeljku 6. tablici 6.1. Priloga III.

27	Vrsta odnosnog instrumenta	Popunjava se kad je identifikator MiFIR izvedenica, razred imovine odnosno instrumenta jest vlasnički vrijednosni papir, a podrazred imovine nije ugovor o razmjeni ni ugovor o razmjeni na razini portfelja.	„STIX” – dionički indeks „SHRS” – dionica „DIVI” – indeks dividendi „DVSE” – dividenda dionice „BSKT” – košarica dionica koja proizlazi iz korporativne akcije „ETFS” – ETF-ovi „VOL” – indeks volatilnosti „OTHR” – ostalo (uključujući potvrde o deponiranim vrijednosnim papirima, certifikate i druge financijske instrumente poput vlasničkih)
----	----------------------------	---	--

▼ B

#	RUBRIKA	POJEDINOSTI O KOJIMA SE IZVJEŠĆUJE	FORMAT ZA IZVJEŠĆIVANJE
		<p>Popunjava se kad je identifikator MiFIR izvedenica, razred imovine odnosno instrumenta jest vlasnički vrijednosni papir, a podrazred imovine je ugovor o razmjeni ili ugovor o razmjeni na razini portfelja, a kriterij segmentacije br. 2 je jedan subjekt kako je definirano u odjeljku 6. tablici 6.1. Priloga III.</p> <p>Popunjava se kad je identifikator MiFIR izvedenica, razred imovine odnosno instrumenta jest vlasnički vrijednosni papir, a podrazred imovine je ugovor o razmjeni ili ugovor o razmjeni na razini portfelja, a kriterij segmentacije br. 2 je jedan subjekt kako je definirano u odjeljku 6. tablici 6.1. Priloga III.</p> <p>Popunjava se kad je identifikator MiFIR izvedenica, razred imovine odnosno instrumenta jest vlasnički vrijednosni papir, a podrazred imovine je ugovor o razmjeni ili ugovor o razmjeni na razini portfelja, a kriterij segmentacije br. 2 je košarica kako je definirano u odjeljku 6. tablici 6.1. Priloga III.</p>	<p>„SHRS” – dionica „DVSE” – dividenda dionice „ETFS” – ETF-ovi „OTHR” – ostalo (uključujući potvrde o deponiranim vrijednosnim papirima, certifikate i druge financijske instrumente poput vlasničkih)</p> <p>„STIX” – dionički indeks „DIVI” – indeks dividendi „VOLI” – indeks volatilnosti „OTHR” – ostalo</p> <p>„BSKT” – košarica</p>
28	Parametar	<p>Popunjava se kad je identifikator MiFIR izvedenica, razred imovine odnosno instrumenta jest vlasnički vrijednosni papir, a podrazred imovine jedno od sljedećeg: ugovori o razmjeni, ugovori o razmjeni na razini portfelja</p>	<p>„PRBP” – parametar <i>price return basic performance</i> „PRDV” – parametar <i>return dividend</i> „PRVA” – parametar <i>return variance</i> „PRVO” – parametar <i>return volatility</i></p>

Ugovori za razlike (CFD)

Rubrike se popunjavaju samo kad je riječ o ugovoru za razlike ili ugovoru o okladama na raspone.

29	Vrsta odnosnog instrumenta	<p>Popunjava se kad je identifikator MiFIR izvedenica i kad je riječ o ugovoru za razlike ili ugovoru o okladama na raspone.</p>	<p>„CURR” – valuta „EQUI” – vlasnički vrijednosni papir „BOND” – obveznice „FTEQ” – budućnosnice koje se odnose na vlasnički vrijednosni papir „OPEQ” – opcije na vlasnički vrijednosni papir „COMM” – roba „EMAL” – emisijske jedinice „OTHR” – ostalo</p>
30	Valuta zamišljene vrijednosti 1	<p>Valuta 1 odnosnog valutnog para. Rubrika se primjenjuje kad je valuta odnosni instrument.</p>	{CURRENCYCODE_3}

▼ B

#	RUBRIKA	POJEDINOSTI O KOJIMA SE IZVJEŠĆUJE	FORMAT ZA IZVJEŠĆIVANJE
31	Valuta zamišljene vrijednosti 2	Valuta 2 odnosnog valutnog para. Rubrika se primjenjuje kad je valuta odnosni instrument.	{CURRENCYCODE_3}

Kreditne izvedenice

32	Oznaka ISIN odnosnog ugovora o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza	U rubrici se za izvedenice na osnovi ugovora o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza navodi oznaka ISIN za odnosni ugovor o razmjeni.	{ISIN}
33	Oznaka odnosnog indeksa	U rubrici se za izvedenice na osnovi indeksa CDS-ova navodi oznaka ISIN za indeks.	{ISIN}
34	Naziv odnosnog indeksa	U rubrici se za izvedenice na osnovi indeksa CDS-ova navodi standardizirani naziv indeksa.	{ALPHANUM-25}
35	Serije	Broj serije sastava indeksa ako je primjenjivo. U rubrici se za indeks CDS-ova ili izvedenicu na osnovi indeksa CDS-ova navodi serija indeksa CDS-ova.	{DECIMAL-18/17}
36	Verzija	Nova verzija serije izdaje se u slučaju neuspjeha jedne sastavnice kad se indeks mora ponovno ponderirati kako bi se u obzir uzeo novi broj ukupnog broja sastavnica indeksa. U rubrici se za indeks CDS-ova ili izvedenicu na osnovi indeksa CDS-ova navodi verzija indeksa CDS-ova.	{DECIMAL-18/17}
37	Mjeseci revizije	Svi mjeseci u kojima se za određenu godinu očekuje revizija koju je predvidio pružatelj indeksa. Rubrika se ponavlja za svaki mjesec revizije. Rubrika se popunjava za indeks CDS-ova ili izvedenicu na osnovi indeksa CDS-ova.	„01”, „02”, „03”, „04”, „05”, „06”, „07”, „08”, „09”, „10”, „11”, „12”
38	Sljedeći datum revizije	U rubrici se za indeks CDS-ova ili izvedenicu na osnovi indeksa CDS-ova navodi sljedeći datum revizije indeksa kako je to predvidio pružatelj indeksa.	{DATEFORMAT}
39	Državni ili javni izdavatelj	Rubrika se popunjava kad je državni izdavatelj referentni subjekt CDS-a jednog subjekta ili izvedenice na osnovi CDS-a jednog subjekta kako je definirano u odjeljku 9. tablici 9.1. Priloga III.	„TRUE” – referentni subjekt je državni ili javni izdavatelj „FALSE” – referentni subjekt nije državni ili javni izdavatelj
40	Referentna obveza	U rubrici se za izvedenice na osnovi ugovora o razmjeni na osnovi nastanka statusa neispunjavanja obveza jednog subjekta navodi oznaka ISIN za referentnu osnovu.	{ISIN}

▼ B

#	RUBRIKA	POJEDINOSTI O KOJIMA SE IZVJEŠĆUJE	FORMAT ZA IZVJEŠĆIVANJE
41	Referentni subjekt	U rubrici se navodi referentni subjekt za CDS jednog subjekta ili izvedenicu na osnovi CDS-a jednog subjekta.	{COUNTRYCODE_2} ili Dvoslovna oznaka države u skladu s normom ISO 3166-2 nakon koje slijedi crtica „-“ i do 3 alfanumerička znaka podjele države ili {LEI}
42	Valuta zamišljene vrijednosti	Valuta u kojoj je zamišljena vrijednost denominirana.	{CURRENCYCODE_3}

Izvedenice emisijskih jedinica

Rubrike u ovom odjeljku popunjavaju se samo za izvedenice emisijskih jedinica kako je definirano u odjeljku 13. tablici 13.1. Priloga III.

43	Podvrsta izvedenica emisijskih jedinica	Rubrika se popunjava kad „DERV” – izvedenica jest varijabla br. 3. „identifikator MiFIR”, „EMAL” – emisijske jedinice jest varijabla br. 4. „razred imovine odnosno instrumenta”.	„CERE” – CER „ERUE” – ERU „EUAE” – EUA „EUAA” – EUAA „OTHR” – ostalo
----	---	---	--

▼ M3

PRILOG V.

Kvantitativni podaci koji se dostavljaju za izračune za potrebe transparentnosti

Tablica 1.

Tablica s oznakama za tablicu 2

Simbol	Vrsta podataka	Definicija
{ALPHANUM-n}	Do n alfanumeričkih znakova	Rubrika za slobodan unos teksta.
{ISIN}	12 alfanumerička znaka	Oznaka ISIN, kako je definirano u normi ISO 6166
{MIC}	4 alfanumerička znaka	Identifikacijska oznaka tržišta, kako je definirano u normi ISO 10383
{DATEFORMAT}	Format datuma u skladu s normom ISO 8601	Datumi se navode u sljedećem formatu: GGGG-MM-DD.
{DECIMAL-n/m}	Decimalni broj od ukupno najviše n znamenki od kojih najviše m znamenki može biti dio decimale	Numeričko polje za pozitivne i negativne vrijednosti. Decimalni razdjelnik je „.” (točka); negativni znakovi imaju predznak „-” (minus); vrijednosti se zaokružuju na višu, a ne smanjuju na nižu vrijednost.
{INTEGER-n}	Cijeli broj od najviše n znamenki	Numeričko polje za pozitivne i negativne vrijednosti cijelih brojeva.

Tablica 2.

Pojediniosti o podacima koje se dostavljaju radi utvrđivanja likvidnog tržišta, pragova za LIS i SSTI za nevladničke financijske instrumente

Br.	Rubrika	Pojediniosti koje se dostavljaju	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format i standardi izvješćivanja
1	Identifikacijska oznaka instrumenta	Oznaka za identifikaciju financijskog instrumenta	Uređeno tržište (RM) Multilateralna trgovinska platforma (MTP) Organizirana trgovinska platforma (OTP) Ovlašteni sustav objavljivanja (APA) Pružatelj konsolidiranih podataka o trgovanju (CTP)	{ISIN}
2	Datum izvršenja	Datum izvršenja transakcija	RM, MTP, OTP, APA, CTP	{DATEFORMAT}

▼ M3

Br.	Rubrika	Pojedinosti koje se dostavljaju	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format i standardi izvješćivanja
3	Mjesto izvršenja	<p>MIC segmenta za mjesto trgovanja ili sistematski internalizator u EU-u ako je dostupan, u protivnom operativni MIC.</p> <p>MIC segmenta za sistematski internalizator ako je dostupan, u protivnom operativni MIC.</p> <p>MIC oznaka „XOFF” za transakcije OTC izvedenicama.</p> <p>APA-e za određeni ISIN i datum izvršenja u jednom unosu iskazuju svo trgovanje OTC izvedenicama za taj instrument (ISIN, XOFF, datum izvršenja).</p>	RM, MTP, OTP, APA, CTP	{MIC} mjesta trgovanja ili sistemskog internalizatora ili „XOFF”
4	Oznaka suspendiranog instrumenta	<p>Navodi se je li instrument na datum izvršenja na određenom mjestu trgovanja bio suspendiran iz trgovanja cijeli dan.</p> <p>Zato se u rubrici 5 iskazuje vrijednost nula.</p>	RM, MTP, OTP	<p>„TRUE” – ako je instrument bio suspendiran iz trgovanja cijeli dan</p> <p>ili „FALSE” – ako instrument nije bio suspendiran iz trgovanja cijeli dan</p>
5	Ukupan broj transakcija	<p>Ukupan broj transakcija izvršenih na datum izvršenja.</p> <p>Ne uključuju se transakcije koje su bile poništene.</p> <p>Transakcije za koje je odobreno odgođeno objavljivanje ubrajaju se u ukupne iznose koje subjekti dostave na temelju datuma izvršenja.</p> <p>U svim slučajevima se u rubrici iskazuje vrijednost jednaka ili veća od nula.</p> <p>U rubrici se za instrumente koji su suspendirani iz trgovanja cijeli dan iskazuje nula.</p>	RM, MTP, OTP, APA, CTP	{INTEGER-18}
6	Ukupni volumen	<p>Ukupni volumen izvršen na datum izvršenja.</p> <p>Volumen se mjeri u skladu s tablicom 4 iz Priloga II. ovoj Uredbi.</p> <p>Monetarni iznosi se iskazuju u eurima.</p> <p>Ne uključuju se transakcije koje su bile poništene.</p> <p>Transakcije za koje je odobreno odgođeno objavljivanje ubrajaju se u ukupne iznose koje subjekti dostave na temelju datuma izvršenja.</p>	RM, MTP, OTP, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

▼ M3

Br.	Rubrika	Pojedinosti koje se dostavljaju	Vrsta mjesta izvršenja ili objave	Format i standardi izvješćivanja
7	Raspon skupine „veličina transakcije”	<p>Ova se rubrika ispunjava vrijednostima iz tablica 3 i 4 ovog Priloga.</p> <p>Raspon skupine „veličina transakcije” kako je definirano:</p> <p>u tablici 4 ovog Priloga za emisijske jedinice i izvedenice koje se na njima temelje;</p> <p>u tablici 3 ovog Priloga za druge instrumente.</p> <p>Podaci za ovu rubriku i rubrike 8 i 9 ne iskazuju se za instrumente koji su suspendirani iz trgovanja cijeni dan.</p>	RM, MTP, OTP, APA, CTP	{ALPHANUM--140}
8	Ukupan broj transakcija izvršenih u toj skupini	<p>Ukupan broj transakcija izvršenih na datum izvršenja koje veličinom pripadaju u taj raspon skupine.</p> <p>Ne uključuju se transakcije koje su bile poništene.</p> <p>Transakcije za koje je odobreno odgođeno objavljivanje ubrajaju se u ukupne iznose koje subjekti dostave na temelju datuma izvršenja.</p>	RM, MTP, OTP, APA, CTP	{INTEGER-18}
9	Ukupan volumen trgovanja za tu skupinu	<p>Ukupan volumen trgovanja koji predstavljaju sve transakcije izvršene na izvještajni datum koje veličinom pripadaju u taj raspon skupine.</p> <p>Volumen se mjeri u skladu s tablicom 4 iz Priloga II. ovoj Uredbi.</p> <p>Monetarni iznosi se iskazuju u eurima.</p> <p>Ne uključuju se transakcije koje su bile poništene.</p> <p>Transakcije za koje je odobreno odgođeno objavljivanje ubrajaju se u ukupne iznose koje subjekti dostave na temelju datuma izvršenja.</p>	RM, MTP, OTP, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

▼ M3

Tablica 3.

Skupine po veličini transakcija za obveznice, strukturirane financijske proizvode, sekuritizirane, kamatne, vlasničke, robne, valutne i kreditne izvedenice, C10 izvedenice i ugovore za razliku (CFD)

Područje primjene	Skupina po veličini transakcija	Definicija
Transakcije veličine od 0 do 1,000,000 (isključeno)]0–100,000[Transakcije veličine manje od 100,000 EUR
	[100,000–100,000]	Transakcije veličine 100,000 EUR
]100,000–200,000[Transakcije veličine od 100,000 EUR do 200,000 EUR
	[200,000–300,000[Transakcije veličine 200,000 EUR ili više do 300,000 EUR
	[300,000–400,000[Transakcije veličine od 300,000 EUR do 400,000 EUR
	[Y–Y + 100,000[Transakcije veličine od EUR Y ili više do EUR Y + 100,000 EUR (korak 100,000 EUR)
	[900,000–1,000,000[Transakcije veličine od 900,000 EUR do 1,000,000 EUR
Transakcije veličine od 1,000,000 (uključeno) do 10,000,000 (isključeno)	[1,000,000–1,500,000[Transakcije veličine od 1,000,000 EUR do 1,500,000 EUR
	[1,500,000–2,000,000[Transakcije veličine od 1,500,000 EUR do 2,000,000 EUR
	[Z–Z + 500,000[Transakcije veličine od EUR Z ili više do EUR Z + 500,000 EUR (korak 500,000 EUR)
	[9,500,000–10,000,000[Transakcije veličine od 9,500,000 EUR do 10,000,000 EUR
Transakcije veličine od 10,000,000 (uključeno) do 100,000,000 (isključeno)	[10,000,000–15,000,000[Transakcije veličine od 10,000,000 EUR do 15,000,000 EUR
	[15,000,000–20,000,000[Transakcije veličine od 15,000,000 EUR do 20,000,000 EUR
	[W–W + 5,000,000[Transakcije veličine od EUR W ili više do EUR W + 5,000,000 EUR (korak 5,000,000 EUR)
	[95,000,000–100,000,000[Transakcije veličine od 95,000,000 EUR do 100,000,000 EUR
Transakcije veličine 100,000,000 ili više	[100,000,000–125,000,000[Transakcije veličine od 100,000,000 EUR do 125,000,000 EUR
	[125,000,000–150,000,000[Transakcije veličine od 125,000,000 EUR do 150,000,000 EUR
	[X–X + 25,000,000[Transakcije veličine od EUR X ili više do EUR X + 25,000,000 EUR (korak 25,000,000 EUR)
...

▼ M3

Tablica 4.

Rasponi skupine po veličini transakcije za emisijske jedinice i izvedenice koje se temelje na emisijskim jedinicama

Područje primjene	Skupina po veličini transakcija	Definicija
Transakcije veličine od 0 do 1,000,000 (isključeno)]0–100,000[Transakcije veličine manje od 100,000 tona ekvivalenta ugljičnog dioksida (tCO ₂ e)
	[100,000–100,000]	Transakcije veličine 100,000 tCO ₂ e
]100,000–200,000[Transakcije veličine od 100,000 tCO ₂ e do 200,000 tCO ₂ e
	[200,000–300,000[Transakcije veličine od 200,000 tCO ₂ e do 300,000 tCO ₂ e
	[300,000–400,000[Transakcije veličine od 300,000 tCO ₂ e do 400,000 tCO ₂ e
	[Y–Y + 100,000[Transakcije veličine Y tCO ₂ e ili više do Y tCO ₂ e + 100,000 (korak 100,000 tCO ₂ e)
	[900,000–1,000,000[Transakcije veličine od 900,000 tCO ₂ e do 1,000,000 tCO ₂ e
Transakcije veličine od 1,000,000 (uključeno) do 10,000,000 (isključeno)	[1,000,000–1,500,000[Transakcije veličine od 1,000,000 tCO ₂ e do 1,500,000 tCO ₂ e
	[1,500,000–2,000,000[Transakcije veličine od 1,500,000 tCO ₂ e do 2,000,000 tCO ₂ e
	[Z–Z + 500,000[Transakcije veličine Z tCO ₂ e ili više do Z tCO ₂ e + 500,000 (korak 500,000 tCO ₂ e)
	[9,500,000–10,000,000[Transakcije veličine od 9,500,000 tCO ₂ e do 10,000,000 tCO ₂ e
Transakcije veličine od 10,000,000 (uključeno) do 100,000,000 (isključeno)	[10,000,000–15,000,000[Transakcije veličine 10,000,000 tCO ₂ e ili više do 15,000,000 tCO ₂ e
	[15,000,000–20,000,000[Transakcije veličine 15,000,000 tCO ₂ e ili više do 20,000,000 tCO ₂ e
	[W–W + 5,000,000[Transakcije veličine W tCO ₂ e ili više do W tCO ₂ e + 5,000,000 (korak 5,000,000 tCO ₂ e)
	[95,000,000–100,000,000[Transakcije veličine 95,000,000 tCO ₂ e ili više do 100,000,000 tCO ₂ e

▼ **M3**

Područje primjene	Skupina po veličini transakcija	Definicija
Transakcije veličine 100,000,000 ili više	[100,000,000–125,000,000[Transakcije veličine 100,000,000 tCO ₂ e ili više do 125,000,000 tCO ₂ e
	[125,000,000–150,000,000[Transakcije veličine 125,000,000 tCO ₂ e ili više do 150,000,000 tCO ₂ e
	[X–X + 25,000,000[Transakcije veličine X tCO ₂ e ili više do X tCO ₂ e +25,000,000 (korak 25,000,000 tCO ₂ e)
...