

GEDELEGEERDE VERORDENING (EU) 2023/945 VAN DE COMMISSIE**van 17 januari 2023****tot wijziging van de in Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/583 vastgestelde technische reguleringsnormen wat betreft bepaalde transparantievereisten die van toepassing zijn op transacties in andere dan eigenvermogensinstrumenten****(Voor de EER relevante tekst)**

DE EUROPESE COMMISSIE,

Gezien het Verdrag betreffende de werking van de Europese Unie,

Gezien Verordening (EU) nr. 600/2014 van het Europees Parlement en de Raad van 15 mei 2014 betreffende markten in financiële instrumenten en tot wijziging van Verordening (EU) nr. 648/2012 ⁽¹⁾, en met name artikel 9, lid 5, derde alinea, artikel 11, lid 4, derde alinea, artikel 14, lid 7, derde alinea, artikel 21, lid 5, derde alinea, en artikel 22, lid 3, tweede alinea,

Overwegende hetgeen volgt:

- (1) Rekening houdend met de ervaring die is opgedaan met de toepassing van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/583 van de Commissie ⁽²⁾, het feit dat sprake is van inconsistente toepassing van bepalingen die afhankelijk zijn van de vraag of een transactie al dan niet koersvormend is, en de veranderingen in handelspraktijken als gevolg van technologische ontwikkelingen en gedragsveranderingen van marktdeelnemers waardoor informatie op kortere termijn kan worden bekendgemaakt, moeten sommige bepalingen van die gedelegeerde verordening worden gewijzigd.
- (2) Het begrip niet-koersvormende transacties, dat relevant is voor de toepassing van de vrijstelling van posttransactionele transparantievereisten voor bilaterale transacties, is door onder toezicht staande entiteiten verschillend uitgelegd, wat heeft geleid tot inconsistente publicatie van posttransactionele transparantie-informatie overeenkomstig artikel 21 van Verordening (EU) nr. 600/2014 van het Europees Parlement en de Raad ⁽³⁾. Om de transparantie en de kwaliteit van de gegevens te verbeteren en uiteindelijk de aggregatie van gegevens te vergemakkelijken, moet de rapportageregeling voor niet-aandelentransacties worden vereenvoudigd en verduidelijkt. Om uiteenlopende interpretaties te voorkomen, moeten de verschillende bepalingen die berusten op het begrip niet-koersvormende transacties in Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/587 ⁽⁴⁾ en in Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/590 van de Commissie ⁽⁵⁾, die betrekking heeft op de melding van transacties aan bevoegde autoriteiten, op elkaar worden afgestemd. Aangezien de lijst van niet-koersvormende transacties in Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/590 alle transacties bevat die van de rapportagevereisten moeten worden uitgesloten, moeten de afzonderlijke transacties in Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/587 worden geschrapt.
- (3) Marktdeelnemers hebben de vereisten inzake pretransactionele transparantie voor hybride handelssystemen verschillend geïnterpreteerd, wat heeft geleid tot inconsistente pretransactionele openbaarmakingen door exploitanten van dergelijke systemen. Hybride systemen zijn systemen die twee of meer handelssystemen combineren. Om ervoor te zorgen dat die marktdeelnemers in de hele Unie op consistente wijze passende pretransactionele informatie openbaar maken, moeten voor hybride handelssystemen pretransactionele transparantievereisten worden ingevoerd die zijn afgestemd op die van de afzonderlijke systemen waaruit het hybride systeem bestaat.

⁽¹⁾ PB L 173 van 12.6.2014, blz. 84.

⁽²⁾ Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/583 van de Commissie van 14 juli 2016 tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 600/2014 van het Europees Parlement en de Raad betreffende markten in financiële instrumenten wat betreft technische reguleringsnormen inzake transparantievereisten voor handelsplatforms en beleggingsondernemingen ten aanzien van obligaties, gestructureerde financiële producten, emissierechten en derivaten (PB L 87 van 31.3.2017, blz. 229).

⁽³⁾ Verordening (EU) nr. 600/2014 van het Europees Parlement en de Raad van 15 mei 2014 betreffende markten in financiële instrumenten en tot wijziging van Verordening (EU) nr. 648/2012 (PB L 173 van 12.6.2014, blz. 84).

⁽⁴⁾ Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/587 van de Commissie van 14 juli 2016 tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 600/2014 van het Europees Parlement en de Raad betreffende markten in financiële instrumenten met technische reguleringsnormen inzake transparantievereisten voor handelsplatforms en beleggingsondernemingen met betrekking tot aandelen, representatieve certificaten, beursverhandelde fondsen, certificaten en andere soortgelijke financiële instrumenten en inzake de verplichting tot uitvoering van transacties in bepaalde aandelen op een handelsplatform of door een beleggingsonderneming met systematische interne afhandeling (PB L 87 van 31.3.2017, blz. 387).

⁽⁵⁾ Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/590 van de Commissie van 28 juli 2016 tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 600/2014 van het Europees Parlement en de Raad ten aanzien van technische reguleringsnormen voor het melden van transacties aan de bevoegde autoriteiten (PB L 87 van 31.3.2017, blz. 449).

- (4) In openbare verslagen over transacties in financiële instrumenten zijn bepaalde belangrijke elementen, zoals prijs, hoeveelheid en notionele waarde, inconsequent uitgedrukt. De wijze waarop deze elementen worden uitgedrukt, moet in overeenstemming zijn met de marktconventies met betrekking tot de afzonderlijke instrumenten. Wat obligaties betreft, moet de prijs in procenten worden uitgedrukt, tenzij de marktconventie voorschrijft dat de prijs van een bepaald type obligatie anders wordt uitgedrukt. Voor kredietverzuimswaps moet de prijs worden uitgedrukt in basispunten die de verkoper van de kredietbescherming ontvangt.
- (5) Transacties waarbij meerdere verschillende obligaties of andere financiële instrumenten tegelijkertijd als portefeuilletransactie tegen één prijs voor de gehele partij worden verkocht aan één cliënt, inclusief tegenpartijen, zijn in de openbare verslagen niet als zodanig herkenbaar. Zonder nauwkeurige identificatie van dergelijke portefeuilletransacties geven de openbare verslagen verschillende afzonderlijke transacties weer tegen een prijs die de marktprijs niet weergeeft. Daarom moet in tabel 3 van bijlage II bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/587 een markering worden toegevoegd voor portefeuilletransacties.
- (6) Handelsplatformen, goedgekeurde publicatieregelingen (APA's) en beleggingsondernemingen hebben de vereisten met betrekking tot de openbaarmaking van posttransactionele transparantie-informatie aan het publiek en de informatie die voor de transparantieberekeningen aan de Europese Autoriteit voor effecten en markten (ESMA) en de bevoegde autoriteiten moet worden verstrekt, niet op dezelfde manier geïnterpreteerd. Als gevolg daarvan is die informatie onvolledig, onjuist of inconsistent. Dit doet afbreuk aan de bruikbaarheid van die informatie en de kwaliteit en nauwkeurigheid van de transparantieberekeningen op basis van de ingediende gegevens. Om de consistente toepassing van de posttransactionele transparantievereisten in de hele Unie te bevorderen, moet nader worden bepaald hoe handelsplatformen, APA's en beleggingsondernemingen details als de prijs en de notionele waarde openbaar moeten maken voor verschillende financiële instrumenten en voor de rapportage van referentiegegevens en kwantitatieve gegevens aan de ESMA en de bevoegde autoriteiten.
- (7) De liquiditeit van grondstoffenderivaten varieert aanzienlijk, afhankelijk van de kenmerken van de instrumenten. De vorm waarin bepaalde kenmerken van grondstoffen- en vrachtderivaten worden gerapporteerd, is momenteel onvoldoende uitgewerkt in Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/583. Om tot een consistente rapportage van die kenmerken te komen en de gegevenskwaliteit te verbeteren, moet die vorm gebaseerd zijn op bestaande markt-normen en nader worden uitgewerkt.
- (8) Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/583 moet dan ook dienovereenkomstig worden gewijzigd.
- (9) Om handelsplatformen, APA's en beleggingsondernemingen in staat te stellen de vereiste wijzigingen in hun systemen door te voeren, moeten bepaalde bij deze verordening ingevoerde wijzigingen van toepassing zijn met ingang van 1 januari 2024. Met het oog op de rechtszekerheid en continuïteit voor transacties die vóór 1 januari 2024 zijn uitgevoerd maar na die datum worden bekendgemaakt of gewijzigd, moeten artikel 12 van en de bijlagen I, II en IV bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/583, zoals van toepassing op 31 december 2023, van toepassing blijven op transacties die vóór 1 januari 2024 zijn uitgevoerd.
- (10) Deze verordening is gebaseerd op het ontwerp van technische reguleringsnormen dat de ESMA bij de Commissie heeft ingediend.
- (11) De ESMA heeft openbare raadplegingen gehouden over de ontwerpen van technische reguleringsnormen waarop deze verordening is gebaseerd, heeft de mogelijke daaraan verbonden kosten en baten geanalyseerd en heeft het advies ingewonnen van de bij artikel 37 van Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad ⁽⁶⁾ opgerichte Stakeholdergroep effecten en markten,

HEEFT DE VOLGENDE VERORDENING VASTGESTELD:

Artikel 1

Wijzigingen van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/583

Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/583 wordt als volgt gewijzigd:

- (1) Aan artikel 4 wordt het volgende lid 4 toegevoegd:

“4. Voor de toepassing van lid 2, punt a), wordt de omvang van de in een faciliteit voor orderadministratie bijgehouden orders gemeten aan de hand van de notionele waarde van de verhandelde contracten als bedoeld in bijlage II, tabel 2, veld 10.”

⁽⁶⁾ Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad van 24 november 2010 tot oprichting van een Europese toezichthoudende autoriteit (Europese Autoriteit voor effecten en markten), tot wijziging van Besluit nr. 716/2009/EG en tot intrekking van Besluit 2009/77/EG van de Commissie (PB L 331 van 15.12.2010, blz. 84).

(2) Artikel 12 wordt vervangen door:

“Artikel 12

Toepassing van transparantie na de handel op bepaalde buiten een handelsplatform uitgevoerde transacties

(artikel 21, lid 1, van Verordening (EU) nr. 600/2014)

De verplichtingen van artikel 21, lid 1, van Verordening (EU) nr. 600/2014 zijn niet van toepassing op de in artikel 2, lid 5, van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/590 (*) genoemde transacties.

(*) Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/590 van de Commissie van 28 juli 2016 tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 600/2014 van het Europees Parlement en de Raad met betrekking tot technische reguleringsnormen voor de melding van transacties aan de bevoegde autoriteiten (PB L 87 van 31.3.2017, blz. 449).”.

(3) Artikel 13 wordt als volgt gewijzigd:

(a) aan lid 5 wordt de volgende alinea toegevoegd:

“De in de eerste alinea bedoelde gegevens worden verzameld overeenkomstig bijlage V.”;

(b) lid 17 wordt vervangen door:

“17. De bevoegde autoriteiten zorgen voor de openbaarmaking van de resultaten van de in lid 5 bedoelde berekeningen voor elk financieel instrument en elke klasse van financiële instrumenten vóór 30 april van het jaar volgend op de datum van toepassing van Verordening (EU) nr. 600/2014 en vóór 30 april van elk daaropvolgend jaar. De resultaten van de berekeningen zijn van toepassing vanaf de eerste maandag van juni van elk jaar volgende op de openbaarmaking tot en met de dag vóór de eerste maandag van juni van het daaropvolgende jaar.”;

18. Voor de berekeningen als bedoeld in lid 1, punt b), i), en in afwijking van de leden 7, 15 en 17 zorgen de bevoegde autoriteiten met betrekking tot obligaties, met uitzondering van ETC's en ETN's, voor de openbaarmaking van de in lid 5, punt a), bedoelde berekeningen op kwartaalbasis, op de eerste maandag van februari, mei, augustus en november na de datum van toepassing van Verordening (EU) nr. 600/2014 en op de eerste maandag van februari, mei, augustus en november van elk daaropvolgend jaar. De berekeningen omvatten de tijdens het voorgaande kalenderkwartaal in de Unie uitgevoerde transacties en zijn van toepassing vanaf de derde maandag van februari, mei, augustus en november van elk jaar totdat de berekeningen van het volgende kwartaal van toepassing zijn.”.

(4) Bijlage I wordt vervangen door de tekst in bijlage I bij deze verordening.

(5) Bijlage II wordt gewijzigd overeenkomstig bijlage II bij deze verordening.

(6) Bijlage III wordt gewijzigd overeenkomstig bijlage III bij deze verordening.

(7) Bijlage IV wordt gewijzigd overeenkomstig bijlage IV bij deze verordening.

(8) De tekst in bijlage V bij deze verordening wordt toegevoegd als bijlage V.

Artikel 2

Overgangsbepaling

Artikel 12 van en de bijlagen I, II en IV bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/583, zoals van toepassing op 31 december 2023, blijven van toepassing op transacties die vóór 1 januari 2024 zijn uitgevoerd.

*Artikel 3***Inwerkingtreding en toepassing**

Deze verordening treedt in werking op de twintigste dag na die van de bekendmaking ervan in het *Publicatieblad van de Europese Unie*.

Artikel 1, punten 2, 4, 5 en 7, is van toepassing met ingang van 1 januari 2024.

Deze verordening is verbindend in al haar onderdelen en is rechtstreeks toepasselijk in elke lidstaat.

Gedaan te Brussel, 17 januari 2023.

Voor de Commissie
De voorzitter
Ursula VON DER LEYEN

BIJLAGE I

"BIJLAGE I

Beschrijving van het systeemtype en de informatie die in verband daarmee openbaar moet worden gemaakt overeenkomstig artikel 2

Systeemtype	Beschrijving van het systeem	Openbaar te maken informatie
Op een continue veiling en een orderboek gebaseerd handelssysteem	Een systeem dat door middel van een orderboek en een handelsalgoritme zonder menselijk ingrijpen continu verkooporders matcht met aankooporders op basis van de beste beschikbare prijs.	Voor elk financieel instrument, het geaggregeerde aantal orders en het overeenkomstige volume op elk koersniveau voor ten minste de beste vijf bied- en laatkoersen.
Prijsgedreven handelssysteem	Een systeem waarin transacties worden gesloten op basis van vaste koersen die continu beschikbaar worden gesteld voor de deelnemers en waarin marktmakers de koersen op een zodanig niveau dienen te handhaven dat er een evenwicht bestaat tussen, enerzijds, de behoeften van leden en deelnemers om op commerciële schaal te handelen en, anderzijds, het risico waaraan de marktmaker zich blootstelt.	Voor elk financieel instrument, de beste bied- en laatkoersen van elke marktmaker in dat instrument, samen met de volumes die bij deze koersen horen. De openbaar gemaakte koersen zijn die welke overeenstemmen met bindende toezeggingen om de financiële instrumenten te kopen en te verkopen, waarbij tevens wordt aangegeven tegen welke koers en welke hoeveelheid financiële instrumenten de geregistreerde marktmakers bereid zijn te kopen of te verkopen. In uitzonderlijke marktomstandigheden kunnen gedurende een beperkte tijd echter indicatieve of enkelzijdige koersen worden toegestaan.
Op een periodieke veiling gebaseerd handelssysteem	Een systeem dat op basis van een periodieke veiling en een handelsalgoritme zonder menselijk ingrijpen orders matcht.	De koers waartegen het op een veiling gebaseerde handelssysteem het best aan zijn handelsalgoritme voldoet, en het volume dat potentieel uitvoerbaar is tegen die koers door deelnemers aan dat systeem.
Prijsaanvraaggedreven handelssysteem	Een handelssysteem waarbij een koers of koersen worden verstrekt in reactie op een prijsaanvraag van een of meer andere leden of deelnemers. De koers kan uitsluitend worden uitgevoerd door het verzoekende lid of de verzoekende marktdeelnemer. Het aanvragende lid of de aanvragende marktdeelnemer kan een transactie sluiten door de op zijn aanvraag verstrekte koers of koersen te aanvaarden.	De koersen en de overeenkomstige volumes van een lid of deelnemer die, indien aanvaard, zouden leiden tot een transactie volgens de regels van het systeem. Alle verstrekte koersen in reactie op een aanvraag kunnen tegelijkertijd openbaar worden gemaakt, maar niet later dan wanneer ze uitvoerbaar worden.
Voicetradingssysteem	Een handelssysteem waarin transacties tussen leden tot stand komen door middel van mondelinge onderhandelingen.	De koop- en verkooporders en de overeenkomstige volumes van een lid of deelnemer die, indien aanvaard, zouden leiden tot een transactie volgens de regels van het systeem.

Systeemtype	Beschrijving van het systeem	Openbaar te maken informatie
Hybride handelssysteem	Een systeem dat onder twee of meer van de in de rijen 1 tot en met 5 van deze tabel bedoelde typen handelssystemen valt.	<p>Voor hybride handelssystemen die verschillende handelssystemen tegelijkertijd combineren, komen de vereisten overeen met de pretransactionele transparantievereisten die gelden voor elk type handelssysteem dat het hybride systeem vormt.</p> <p>Voor hybride handelssystemen die twee of meer handelssystemen na elkaar combineren, komen de vereisten overeen met de pretransactionele transparantievereisten die gelden voor het respectieve handelssysteem dat op een bepaald tijdstip wordt geëxploiteerd.</p>
Elk ander handelssysteem	Elk ander type handelssysteem dat niet onder de rijen 1 tot en met 6 valt.	Toereikende informatie over de hoogte van de orders of koersen en van handelsbelangen; met name de beste vijf bied- en laatkoersen en/of dubbele koersen van elke marktmaker in het instrument, indien de kenmerken van het koersvormingsmechanisme zulks mogelijk maken.”

BIJLAGE II

Bijlage II wordt als volgt gewijzigd:

1) Tabel 2 wordt vervangen door:

"Tabel 2

Lijst van details ten behoeve van posttransactionele transparantie

#	Veldnaam	Financiële instrumenten	Beschrijving en openbaar te maken details	Type uitvoering of publicatieplatform	Overeenkomstig tabel 1 in te vullen formaat
1	Transactiedatum en -tijdstip	Voor alle financiële instrumenten	<p>Datum en tijdstip van uitvoering van de transactie.</p> <p>Voor op een handelsplatform uitgevoerde transacties is de mate van granulariteit in overeenstemming met de vereisten van artikel 2 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/574 van de Commissie ⁽¹⁾.</p> <p>Voor niet op een handelsplatform uitgevoerde transacties zijn de datum en het tijdstip die waarop de partijen de inhoud van de volgende velden overeenkomen: hoeveelheid, koers, valuta, als gespecificeerd in de velden 31, 34 en 44 van tabel 2 van bijlage I bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/590, instrumentenidentificatiecode, instrumentindeling en code van het onderliggende instrument, indien van toepassing. Voor niet op een handelsplatform uitgevoerde transacties is het gemelde tijdstip granulair op ten minste de dichtstbijzijnde seconde.</p> <p>Wanneer de transactie resulteert uit een namens een cliënt door de uitvoerende beleggingsonderneming aan een derde doorgegeven order waarbij de voorwaarden voor doorgifte als omschreven in artikel 4 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/590 niet zijn vervuld, zijn de datum en het tijdstip die van de transactie in plaats van die van de order.</p>	<p>Gereglementeerde markt (RM)</p> <p>Multilaterale handelsfaciliteit (MTF), georganiseerde-handelsfaciliteit (OTF)</p> <p>Goedgekeurde publicatieregeling (APA)</p> <p>Verstrekker van consolidated tape (CTP)</p>	{DATE_TIME_FORMAT}
2	Instrument-identificatiecode	Voor alle financiële instrumenten	Voor het identificeren van het financieel instrument gebruikte code	RM, MTF, OTF APA CTP	{ISIN}.
3	Prijs	Voor alle financiële instrumenten	<p>Uitgevoerde prijs van de transactie, in voorkomend geval exclusief provisie en opgelopen rente.</p> <p>De uitgevoerde prijs wordt gerapporteerd overeenkomstig de standaardmarktconventie. De in dit veld verstrekte waarde is consistent met de in het veld "Eenheid van de prijs" ingevulde waarde.</p> <p>Wanneer de prijs op dat moment niet beschikbaar is maar hangende ("PNDG") of niet van toepassing ("NOAP") is, wordt dit veld niet ingevuld.</p>	RM, MTF, OTF APA, CTP	<p>{DECIMAL-18/13} wanneer de prijs wordt uitgedrukt in geldwaarde</p> <p>{DECIMAL-11/10} wanneer de prijs wordt uitgedrukt als percentage of rendement</p> <p>{DECIMAL-18/17} wanneer de prijs wordt uitgedrukt in basispunten</p>

#	Veldnaam	Financiële instrumenten	Beschrijving en openbaar te maken details	Type uitvoering of publicatieplatform	Overeenkomstig tabel 1 in te vullen formaat
4	Ontbrekende prijs	Voor alle financiële instrumenten	<p>Wanneer de prijs op dat moment niet beschikbaar is maar hangende, moet de waarde "PNDG" zijn.</p> <p>Wanneer de prijs niet van toepassing is, moet de waarde "NOAP" zijn.</p>	RM, MTF, OTF APA, CTP	<p>"PNDG" wanneer de prijs niet beschikbaar is</p> <p>"NOAP" wanneer de prijs niet van toepassing is</p>
5	Valuta van de prijs	Voor alle financiële instrumenten	Hoofdvaluta waarin de prijs wordt uitgedrukt (van toepassing indien de prijs wordt uitgedrukt in monetaire waarde).	RM, MTF, OTF APA, CTP	{CURRENCYCODE_3}
6	Eenheid van de prijs	Voor alle financiële instrumenten	<p>Indicatie of de prijs wordt uitgedrukt als geldwaarde, percentage, basispunten of rendement</p> <p>De eenheid van de prijs wordt gerapporteerd overeenkomstig de standaardmarktconventie.</p> <p>Voor kredietverzuimswaps wordt in dit veld "BAPO" ingevuld.</p> <p>Voor obligaties (andere dan ETN's en ETC's) wordt in dit veld het percentage (PERC) van de notionele waarde ingevuld. Wanneer een prijs in procenten niet de standaardmarktconventie is, wordt YIEL, BAPO of MONE ingevuld, overeenkomstig de standaardmarktconventie.</p> <p>De in dit veld verstrekte waarde is consistent met de in het veld "Prijs" ingevulde waarde.</p> <p>Indien de prijs in geldelijke waarde wordt gerapporteerd, wordt deze in de hoofdvaluta eenheid gegeven.</p> <p>Wanneer de prijs op dat moment niet beschikbaar is maar hangende ("PNDG") of niet van toepassing ("NOAP") is, wordt dit veld niet ingevuld.</p>	RM, MTF, OTF APA CTP	<p>"MONE" — Geldwaarde</p> <p>"PERC" — Percentage</p> <p>"YIEL" — Yield</p> <p>"BAPO" — Basispunten</p>

#	Veldnaam	Financiële instrumenten	Beschrijving en openbaar te maken details	Type uitvoering of publicatieplatform	Overeenkomstig tabel 1 in te vullen formaat
7	Hoeveelheid	Voor alle financiële instrumenten, behoudens in de in artikel 11, lid 1, punten a) en b), van deze verordening beschreven gevallen.	Voor financiële instrumenten die in eenheden worden verhandeld, het aantal eenheden van het financiële instrument. Anders leeg.	RM, MTF, OTF APA CTP	{DECIMAL-18/17}
8	Hoeveelheid in de meeteenheid	Voor contracten uitgedrukt in eenheden in grondstoffenderivaten, C10-derivaten, emissierechtenderivaten en emissierechten, behoudens in de in artikel 11, lid 1, punten a) en b), van deze verordening beschreven gevallen.	De equivalente hoeveelheid van een verhandelde grondstof of een verhandeld emissierecht uitgedrukt in de meeteenheid.	RM, MTF, OTF APA CTP	{DECIMAL-18/17}
9	Notatie van de hoeveelheid in de meeteenheid	Voor contracten uitgedrukt in eenheden in grondstoffenderivaten, C10-derivaten, emissierechtenderivaten en emissierechten, behoudens in de in artikel 11, lid 1, punten a) en b), van deze verordening beschreven gevallen	Indicatie van de notatie waarin de hoeveelheid in de meeteenheid wordt uitgedrukt.	RM, MTF, OTF APA CTP	<p>“TOCD” — ton kooldioxide-equivalent, voor alle contracten met betrekking tot emissierechten</p> <p>“TONE” — metrieke ton</p> <p>“MWHO” — megawattuur</p> <p>“MBTU” — één miljoen Britse thermische eenheden,</p> <p>“THMS” — Therms</p> <p>“DAYS”— dagen</p> <p>of</p> <p>{ALPHANUM-4} anders</p>

#	Veldnaam	Financiële instrumenten	Beschrijving en openbaar te maken details	Type uitvoering of publicatieplatform	Overeenkomstig tabel 1 in te vullen formaat
10	Notionele waarde	Voor alle financiële instrumenten, behoudens in de in artikel 11, lid 1, punten a) en b), van deze verordening beschreven gevallen.	<p>In dit veld wordt ingevuld:</p> <ul style="list-style-type: none"> i) voor obligaties (met uitzondering van ETC's en ETN's): de nominale waarde, zijnde het bedrag dat bij aflossing aan de belegger wordt terugbetaald; ii) voor ETC's en ETN's en geseuritiseerde derivaten: het aantal tussen kopers en verkopers uitgewisselde instrumenten vermenigvuldigd met de prijs van het voor die specifieke transactie uitgewisselde instrument. Op gelijke wijze, het veld "prijs" vermenigvuldigd met het veld "hoeveelheid"; iii) voor gestructureerde financiële producten (SFP's): de nominale waarde per eenheid vermenigvuldigd met het aantal instrumenten ten tijde van de transactie; iv) voor credit default swaps: het notionele bedrag waarvoor de protectie wordt verkregen of vervreemd; v) voor opties, swaptions, swaps die niet onder iv) vallen, futures en termijncontracten: het notionele bedrag van het contract; vi) voor emissierechten: het bedrag dat voortvloeit uit de hoeveelheid tegen de relevante prijs die in het contract is vastgesteld ten tijde van de transactie. Op gelijke wijze, het veld "prijs" vermenigvuldigd met het veld "hoeveelheid in de meeteenheid"; vii) voor spread bets: de ingezette geldwaarde per punt beweging in het onderliggende financiële instrument ten tijde van de transactie; viii) voor contracts for difference: het aantal tussen kopers en verkopers uitgewisselde instrumenten vermenigvuldigd met de prijs van het voor die specifieke transactie uitgewisselde instrument. Op gelijke wijze, het veld "prijs" vermenigvuldigd met het veld "hoeveelheid"; 	RM, MTF, OTF APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

#	Veldnaam	Financiële instrumenten	Beschrijving en openbaar te maken details	Type uitvoering of publicatieplatform	Overeenkomstig tabel 1 in te vullen formaat
11	Notionele valuta	Voor alle financiële instrumenten, behoudens in de in artikel 11, lid 1, punten a) en b), van deze verordening beschreven gevallen.	<p>Hoofdvaluta waarin de notionele waarde is uitgedrukt.</p> <p>In het geval van een valutaderivatencontract, een multi-currency swap of een swaption waarbij de onderliggende swap een multi-currency swap, een valuta-CFD of een spread betting-contract is, is dit de notionele valuta van deel 1.</p>	RM, MTF, OTF APA, CTP	{CURRENCYCODE_3}
12	Soort	Alleen voor emissierechten en emissierechtenderivaten	Dit veld is alleen van toepassing op emissierechten en emissierechtenderivaten.	RM, MTF, OTF APA CTP	<p>“EUAE” — EUA</p> <p>“CERE” — CER</p> <p>“ERUE” — ERU</p> <p>“EUAA” — EUAA</p> <p>“OTHR” — Overig</p>
13	Plaats van uitvoering	Voor alle financiële instrumenten	<p>Identificatie van de plaats waar de transactie is uitgevoerd.</p> <p>Gebruik de segment-MIC van ISO 10383 voor op een handelsplatform in de EU uitgevoerde transacties. Wanneer de segment-MIC niet bestaat, gebruik dan de exploitant-MIC.</p> <p>Gebruik “SINT” voor financiële instrumenten die zijn toegelaten tot de handel of worden verhandeld op een handelsplatform, indien de transactie in dat financiële instrument wordt uitgevoerd via een beleggingsonderneming met systematische interne afhandeling.</p> <p>Gebruik de MIC “XOFF” voor financiële instrumenten die zijn toegelaten tot de handel of worden verhandeld op een handelsplatform, wanneer de transactie in dat financiële instrument niet wordt uitgevoerd op een handelsplatform in de EU en evenmin via een beleggingsonderneming met systematische interne afhandeling. Indien de transactie wordt uitgevoerd op een georganiseerd handelsplatform buiten de EU, moet naast “XOFF” ook het veld “handelsplatform van uitvoering in een derde land” worden ingevuld.</p>	RM, MTF, OTF APA, CTP	<p>{MIC} – handelsplatforms in de EU, of</p> <p>“SINT” — beleggingsonderneming met systematische interne afhandeling</p> <p>“XOFF” — anders</p>

#	Veldnaam	Financiële instrumenten	Beschrijving en openbaar te maken details	Type uitvoering of publicatieplatform	Overeenkomstig tabel 1 in te vullen formaat
14	Handelsplatform van uitvoering in een derde land	Voor alle financiële instrumenten	<p>Identificatie van het handelsplatform in een derde land waar de transactie is uitgevoerd.</p> <p>Gebruik de segment-MIC van ISO 10383. Wanneer de segment-MIC niet bestaat, gebruik dan de exploitant-MIC.</p> <p>Indien de transactie niet op een handelsplatform van een derde land wordt uitgevoerd, wordt het veld niet ingevuld.</p>	APA, CTP	{MIC}
15	Datum en tijdstip van openbaarmaking	Voor alle financiële instrumenten	<p>Datum en tijdstip van de openbaarmaking van de transactie door een handelsplatform of APA.</p> <p>Voor op een handelsplatform uitgevoerde transacties is de mate van granulariteit in overeenstemming met de vereisten van artikel 2 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/574.</p> <p>Voor niet op een handelsplatform uitgevoerde transacties is het gemelde tijdstip granulair op ten minste de dichtstbijzijnde seconde.</p>	RM, MTF, OTF APA CTP	{DATE_TIME_FORMAT}
16	Platform van openbaarmaking	Voor alle financiële instrumenten	Voor de identificatie van het handelsplatform en de APA die de transactie openbaar maakt gebruikte code.	CTP	<p>Handelsplatform: {MIC}</p> <p>APA: {MIC} indien beschikbaar. Anders, een uit 4 karakters bestaande code als gepubliceerd in de lijst van datarapporteringsdiensten op de website van de ESMA.</p>
17	Transactie-identificatiecode	Voor alle financiële instrumenten	Alfanumerieke code die wordt toegekend door handelsplatforms (krachtens artikel 12 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/580 ⁽²⁾ van de Commissie) en APA's en die wordt gebruikt voor daaropvolgende verwijzingen naar de specifieke transactie.	RM, MTF, OTF APA CTP	{ALPHANUMERICAL-52}

#	Veldnaam	Financiële instrumenten	Beschrijving en openbaar te maken details	Type uitvoering of publicatieplatform	Overeenkomstig tabel 1 in te vullen formaat
			<p>De transactie-identificatiecode is uniek, consistent en persistent voor elke segment-MIC volgens ISO 10383 en voor elke handelsdag. Indien het handelsplatform geen segment-MIC's gebruikt, is de transactie-identificatiecode uniek, consistent en persistent voor elke exploitant-MIC en elke handelsdag.</p> <p>Indien een APA geen MIC's gebruikt, moet de transactie-identificatiecode uniek, consistent en persistent zijn voor elke uit 4 karakters bestaande code die wordt gebruikt om de APA te identificeren voor elke handelsdag.</p> <p>De identiteit van de tegenpartijen bij de transactie waarvoor de transactie-identificatiecode wordt bijgehouden, kan niet worden afgeleid uit de onderdelen van deze code.</p>		
18	Te clearen transactie	Voor derivaten	Code om vast te stellen of de transactie zal worden gecleard.	RM, MTF, OTF APA CTP	<p>“TRUE” — transactie zal worden gecleard</p> <p>“FALSE” — transactie zal niet worden gecleard</p>

(¹) Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/574 van de Commissie van 7 juni 2016 tot aanvulling van Richtlijn 2014/65/EU van het Europees Parlement en de Raad met betrekking tot technische reguleringsnormen voor het accuratesseniveau van beursklokken (PB L 87 van 31.3.2017, blz. p. 148).

(²) Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/580 van de Commissie van 24 juni 2016 tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 600/2014 van het Europees Parlement en de Raad ten aanzien van technische reguleringsnormen voor het bijhouden van relevante gegevens met betrekking tot orders in financiële instrumenten (PB L 87 van 31.3.2017, blz. p. 193).

Gedelegeerde Verordening (EU) nr. 148/2013 tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad betreffende otc-derivaten, centrale tegenpartijen en transactieregisters met technische reguleringsnormen inzake de minimale mate van gedetailleerdheid van de aan transactieregisters te rapporteren gegevens.”;

2) Tabel 3 wordt vervangen door:

“Tabel 3

Lijst van markeringen ten behoeve van transparantie na de handel

Markering	Naam	Type uitvoering of publicatieplatform	Beschrijving
“BENC”	Benchmarktransactie	RM, MTF, OTF APA CTP	Transacties die worden uitgevoerd op basis van een referentieprijs die op meerdere tijdstippen wordt berekend ten opzichte van een bepaalde benchmark, zoals de volume- of tijdgewogen gemiddelde referentieprijs.
“ACTX”	Kruistransactie door beleggingsonderneming (Agency cross transaction)	APA CTP	Transacties waarbij een beleggingsonderneming orders van twee cliënten samenvoegt en de aankoop en verkoop als een enkele transactie uitvoert voor hetzelfde volume en tegen dezelfde prijs.
“NPFT”	Niet-koersvormende transactie (Non-price forming transaction)	RM, MTF, OTF CTP	Niet-koersvormende transacties als bedoeld in artikel 2, lid 5, van Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/590.

Markering	Naam	Type uitvoering of publicatieplatform	Beschrijving
“LRGS”	Large in Scale (LIS) transactie met uitstel van transparantie na de handel	RM, MTF, OTF APA CTP	Transacties die worden uitgevoerd met uitstel van de transparantie na de handel voor transacties van aanzienlijke omvang.
“ILQD”	Transacties in niet-liquide instrumenten	RM, MTF, OTF APA CTP	Transacties die worden uitgevoerd met uitstel voor instrumenten waarvoor geen liquide markt bestaat.
“SIZE”	SSTI (Size Specific to the Instrument) transactie met uitstel van transparantie na de handel	RM, MTF, OTF APA CTP	Transacties die worden uitgevoerd met uitstel van transparantie na de handel op basis van de voor het financieel instrument specifieke omvang
“TPAC”	Pakkettransactie (Package transaction)	RM, MTF, OTF APA CTP	Pakkettransactie die geen exchange for physicals als omschreven in artikel 1 is.
“XFPH”	Exchange for physicals-transactie	RM, MTF, OTF APA CTP	Exchange for physicals als omschreven in artikel 1
“CANC”	Annulering (Cancellation)	RM, MTF APA CTP	Wanneer een eerder openbaar gemaakte transactie wordt geannuleerd.
“AMND”	Wijziging (Amendment)	RM, MTF APA CTP	Wanneer een eerder openbaar gemaakte transactie wordt gewijzigd.
“PORT”	Portefeuilletransactie	RM, MTF APA CTP	Transactie in vijf of meer verschillende financiële instrumenten, waarbij deze instrumenten op hetzelfde tijdstip en door dezelfde cliënt tegen één partijprijs worden verhandeld, die geen “pakkettransactie” in de zin van artikel 1, lid 1, is.

MARKERINGEN VOOR AANVULLEND UITSTEL

Artikel 11, lid 1, punt a), i).	“LMTF”	Beperkte hoeveelheid details	RM, MTF, OTF, APA CTP	Eerste verslag met openbaarmaking van een beperkte hoeveelheid details overeenkomstig artikel 11, lid 1, punt a), i).
	“FULF”	Alle details (Full details)		Transactie waarvoor eerder een beperkte hoeveelheid details is openbaar gemaakt overeenkomstig artikel 11, lid 1, punt a), i).
Artikel 11, lid 1, punt a), ii).	“DATF”	Dagelijks geaggregeerde transactie (Daily aggregated transaction)	RM, MTF, OTF, APA CTP	Openbaarmaking van dagelijks geaggregeerde transactie overeenkomstig artikel 11, lid 1, punt a), ii).
	“FULA”	Alle details (Full details)	RM, MTF, OTF APA CTP	Afzonderlijke transactie waarvoor eerder dagelijks geaggregeerde details zijn openbaar gemaakt overeenkomstig artikel 11, lid 1, punt a), ii).

Artikel 11, lid 1, punt b)	“VOLO”	Volumeweglating (Volume omission)	RM, MTF, OTF, APA CTP	Transactie waarvoor een beperkte hoeveelheid details wordt openbaar gemaakt overeenkomstig artikel 11, lid 1, punt b).
	“FULV”	Alle details (Full details)	RM, MTF, OTF, APA CTP	Transactie waarvoor eerder een beperkte hoeveelheid details is openbaar gemaakt overeenkomstig artikel 11, lid 1, punt b).
Artikel 11, lid 1, punt c)	“FWAF”	Aggregatie over vier weken (Four weeks aggregation)	RM, MTF, OTF, APA CTP	Openbaarmaking van geaggregeerde transacties overeenkomstig artikel 11, lid 1, punt c).
	“FULJ”	Alle details (Full details)	RM, MTF, OTF, APA CTP	Afzonderlijke transacties die eerder hebben geprofiteerd van geaggregeerde openbaarmaking overeenkomstig artikel 11, lid 1, punt c).

Artikel 11, lid 1, punt d)	“IDAF”	Aggregatie voor onbepaalde tijd (Indefinite aggregation)	RM, MTF, OTF, APA CTP	Transacties waarvoor de openbaarmaking van verscheidene transacties in geaggregeerde vorm voor onbepaalde tijd is toegestaan overeenkomstig artikel 11, lid 1, punt d).
Achterevolgend gebruik van artikel 11, lid 1, punt b), en artikel 11, lid 2, punt c), voor overheidsschuldinstrumenten.	“VOLW”	Volumeweglating (Volume omission)	RM, MTF, OTF, APA CTP	Transactie waarvoor een beperkte hoeveelheid details wordt openbaar gemaakt overeenkomstig artikel 11, lid 1, punt b), en waarvoor vervolgens de openbaarmaking van verscheidene transacties in geaggregeerde vorm voor onbepaalde tijd zal worden toegestaan overeenkomstig artikel 11, lid 2, punt c).
	“COAF”	Consecutieve aggregatie (volumeweglating voor overheidsschuldinstrumenten) (Consecutive aggregation)	RM, MTF, OTF, APA CTP	Transacties waarvoor eerder een beperkte hoeveelheid details is openbaar gemaakt overeenkomstig artikel 11, lid 1, punt b), en waarvoor vervolgens de openbaarmaking van verscheidene transacties in geaggregeerde vorm voor onbepaalde tijd is toegestaan overeenkomstig artikel 11, lid 2, punt c).”;

3) Tabel 4 wordt vervangen door:

“Tabel 4

Volumemaatstaf

Type instrument	Volume
Alle obligaties met uitzondering van ETC's en ETN's en gestructureerde financiële producten	“Notionele waarde” van het verhandelde contract volgens veld 10 van tabel 2 van bijlage II bij deze verordening.
Obligatietypen ETC en ETN	“Notionele waarde” van het verhandelde contract volgens veld 10 van tabel 2 van bijlage II bij deze verordening.
Gesecuritiseerde derivaten	“Notionele waarde” van het verhandelde contract volgens veld 10 van tabel 2 van bijlage II bij deze verordening.
Rentederivaten	“Notionele waarde” van het verhandelde contract volgens veld 10 van tabel 2 van bijlage II bij deze verordening.

Type instrument	Volume
Valutaderivaten	“Notionele waarde” van het verhandelde contract volgens veld 10 van tabel 2 van bijlage II bij deze verordening.
Aandelenderivaten	“Notionele waarde” van het verhandelde contract volgens veld 10 van tabel 2 van bijlage II bij deze verordening.
Grondstoffenderivaten	“Notionele waarde” van het verhandelde contract volgens veld 10 van tabel 2 van bijlage II bij deze verordening.
Kredietderivaten	“Notionele waarde” van het verhandelde contract volgens veld 10 van tabel 2 van bijlage II bij deze verordening.
Contract for differences	“Notionele waarde” van het verhandelde contract volgens veld 10 van tabel 2 van bijlage II bij deze verordening.
C10-derivaten	“Notionele waarde” van het verhandelde contract volgens veld 10 van tabel 2 van bijlage II bij deze verordening.
Emissierechtenderivaten	“Hoeveelheid in de meeteenheid” volgens veld 8 van tabel 2 van bijlage II bij deze verordening.
Emissierechten	“Hoeveelheid in de meeteenheid” volgens veld 8 van tabel 2 van bijlage II bij deze verordening.”.

Bijlage III wordt als volgt gewijzigd:

1) In deel 1 wordt het volgende punt 16 toegevoegd:

“16. Onder “optie op een swap” wordt verstaan: een optiecontract dat de eigenaar het recht geeft, maar niet de verplichting oplegt om op of tot een bepaalde toekomstige datum een swap aan te gaan.”.

2) Tabel 2.2 wordt vervangen door:

“Tabel 2.2

Obligaties (alle obligatietypen met uitzondering van ETC's en ETN's) — klassen waarvoor geen liquide markt bestaat

Activaklassen — Obligaties (alle obligatietypen met uitzondering van ETC's en ETN's)			
Voor elke afzonderlijke obligatie wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 13, lid 18, wanneer zij wordt gekenmerkt door een specifieke combinatie van obligatietype en uitgifteomvang zoals gespecificeerd in elke rij van de tabel			
Obligatietype		Omvang van de uitgifte - RTS23#14	
Overheidsobligatie RTS2#3 = BOND en RTS2#9 = EUSB	een obligatie die noch een converteerbare, noch een gedekte obligatie is en wordt uitgegeven door een overheidsemittent: (a) de Unie; (b) een lidstaat, met inbegrip van een regeringsdepartement, een agentschap of een special purpose vehicle van de lidstaat; (c) een niet onder de punten a) en b) vallende overheidsentiteit.	kleiner dan (in EUR)	1 000 000 000

Activaklassen — Obligaties (alle obligatietypen met uitzondering van ETC's en ETN's)

Obligatietype		Omvang van de uitgifte - RTS23#14			
Andere overheidsobligatie RTS2#3 = BOND en RTS2#9 = OEPB	een obligatie die noch een converteerbare, noch een gedekte obligatie is en wordt uitgegeven door een van de volgende overheidsemissanten: (a) in het geval van een lidstaat die een federale staat is, een lid van de federatie; (b) een special purpose vehicle voor verscheidene lidstaten; (c) een door twee of meer lidstaten opgerichte internationale financiële instelling die tot doel heeft middelen bijeen te brengen en financiële bijstand te verlenen ten behoeve van haar leden als deze ernstige financiële problemen ondervinden of dreigen te ondervinden; (d) de Europese Investeringsbank; (e) een overheidsentiteit die geen emittent van een overheidsobligatie als gespecificeerd in de vorige rij is.	kleiner dan (in EUR)		500 000 000	
Converteerbare obligatie RTS2#3 = BOND en RTS2#9 = CVTB	een instrument dat bestaat uit een obligatie of een gesecuritiseerd schuldinstrument met een ingebed derivaat, zoals een optie om het onderliggende aandeel te kopen.	kleiner dan (in EUR)		500 000 000	
Gedekte obligatie RTS2#3 = BOND en RTS2#9 = CVDB	een obligatie als omschreven in artikel 52, lid 4, van Richtlijn 2009/65/EG	tijdens de fasen S1 en S2		tijdens de fasen S3 en S4	
		kleiner dan (in EUR)	1 000 000 000	kleiner dan (in EUR)	500 000 000

Activaklassen — Obligaties (alle obligatietypen met uitzondering van ETC's en ETN's)					
Obligatietype		Omvang van de uitgifte - RTS23#14			
		tijdens de fasen S1 en S2		tijdens de fasen S3 en S4	
Bedrijfsobligatie RTS2#3 = BOND en RTS2#9 = CRPB	een obligatie die noch een converteerbare, noch een gedekte obligatie is en die is uitgegeven door een in overeenstemming met Verordening (EG) nr. 2157/2001 van de Raad ⁽¹⁾ opgerichte Societas Europaea of een type vennootschap als vermeld in bijlage 1 of bijlage 2 van Richtlijn 2013/34/EG van het Europees Parlement en de Raad ⁽²⁾ of een equivalent daarvan in derde landen.	kleiner dan (in EUR)	1 000 000 000	kleiner dan (in EUR)	500 000 000
Obligatietype	Om te bepalen voor welke financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 13, lid 18, wordt de volgende methodologie toegepast				
Andere obligatie RTS2#3 = BOND en RTS2#9 = OTHR	Voor een obligatie die niet tot een van bovengenoemde obligatietypen behoort, wordt geacht geen liquide markt te bestaan				

⁽¹⁾ Verordening (EG) nr. 2157/2001 van de Raad van 8 oktober 2001 betreffende het statuut van de Europese vennootschap (SE) (PB L 294 van 10.11.2001, blz. 1).

⁽²⁾ Richtlijn 2013/34/EU van het Europees Parlement en de Raad van 26 juni 2013 betreffende de jaarlijkse financiële overzichten, geconsolideerde financiële overzichten en aanverwante verslagen van bepaalde ondernemingsvormen, tot wijziging van Richtlijn 2006/43/EG van het Europees Parlement en de Raad en tot intrekking van Richtlijnen 78/660/EEG en 83/349/EEG van de Raad (PB L 182 van 29.6.2013, blz. 19).".

3) Tabel 2.4 wordt vervangen door:

“Tabel 2.4

Obligaties (obligatietypen ETC en ETN) — klassen waarvoor geen liquide markt bestaat

Obligatietype	Voor elk afzonderlijk financieel instrument wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer het niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria	
	Gemiddelde dagelijkse omzet [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
<p>Exchange Traded Commodities (ETC's) - RTS2#3 = ETCS</p> <p>een schuldinstrument dat is uitgegeven tegen een rechtstreekse belegging door de emittent in grondstoffen- of grondstoffenderivatencontracten. De koers van een ETC is rechtstreeks of onrechtstreeks gekoppeld aan de prestaties van het onderliggende. Een ETC volgt passief de prestaties van de grondstof of grondstoffenindices waarop hij betrekking heeft.</p>	500 000 EUR	10
<p>Exchange Traded Notes (ETN's) - RTS2#3 = ETNS</p> <p>een schuldinstrument dat is uitgegeven tegen een rechtstreekse belegging door de emittent in het onderliggende of de onderliggende derivatencontracten. De koers van een ETN is rechtstreeks of onrechtstreeks gekoppeld aan de prestaties van het onderliggende. Een ETN volgt passief de prestaties van het onderliggende waarop hij betrekking heeft.</p>	500 000 EUR	10.”

4) Tabel 3.1 wordt vervangen door:

“Tabel 3.1

GFP's — klassen waarvoor geen liquide markt bestaat

Activaklasse — Gestructureerde financiële producten (GFP's)
Toets 1 — beoordeling activaklasse van GFP's

De beoordeling van de activaklasse GFP's voor het bepalen van de financiële instrumenten waarvoor wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b) – RTS2#3 = SFPS

In aanmerking te nemen transacties voor de berekening van de waarden die verband houden met de kwantitatieve liquiditeitscriteria voor de beoordeling van de activaklasse van GFP's	De activaklasse van GFP's wordt beoordeeld door toepassing van de volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria	
	Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
In alle GFP's uitgevoerde transacties	300 000 000 EUR	500

Toets 2 — GFP's waarvoor geen liquide markt bestaat
--

Wanneer de waarden die verband houden met de kwantitatieve liquiditeitscriteria, boven de voor de beoordeling van de activaklasse van GFP's vastgestelde kwantitatieve liquiditeitsdrempels liggen, is toets 1 gehaald en wordt toets 2 uitgevoerd. Voor elk afzonderlijk financieel instrument wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer het niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria

Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Percentage verhandelingsdagen in de betrokken periode [kwantitatief liquiditeitscriterium 3]
100 000 EUR	2	80 %".

5) Tabel 4.1 wordt vervangen door:

“Tabel 4.1

Gesecuritiseerde derivaten — klassen waarvoor geen liquide markt bestaat

Activaklasse – Gesecuritiseerde derivaten

een overdraagbaar effect als omschreven in artikel 4, lid 1, punt 44, c), van Richtlijn 2014/65/EU anders dan een gestructureerd financieel product, dat ten minste het volgende moet omvatten:

- a.1) plain vanilla gedekte warrants: door een financiële instelling uitgegeven effecten die de houder het recht geven, maar niet de verplichting opleggen, om
 - a) op of tot de vervaldatum een specifieke hoeveelheid van het onderliggende actief te kopen tegen een vooraf bepaalde uitoefenprijs of, indien afwikkeling in contanten is vastgesteld, de betaling van het positieve verschil tussen de actuele marktprijs en de uitoefenprijs; of
 - b) op of tot de vervaldatum een specifieke hoeveelheid van het onderliggende actief te verkopen tegen een vooraf bepaalde uitoefenprijs of, indien afwikkeling in contanten is vastgesteld, de betaling van het positieve verschil tussen de uitoefenprijs en de actuele marktprijs door de koper;
- a.2) warrants: effecten die zijn uitgegeven door dezelfde emittent van het onderliggende actief en die de houder het recht geven, maar niet de verplichting opleggen, om
 - a) op of tot de vervaldatum een specifieke hoeveelheid van het onderliggende actief te kopen tegen een vooraf bepaalde uitoefenprijs of, indien afwikkeling in contanten is vastgesteld, de betaling van het positieve verschil tussen de actuele marktprijs en de uitoefenprijs; of
 - b) op of tot de vervaldatum een specifieke hoeveelheid van het onderliggende actief te verkopen tegen een vooraf bepaalde uitoefenprijs of, indien afwikkeling in contanten is vastgesteld, de betaling van het positieve verschil tussen de uitoefenprijs en de actuele marktprijs door de koper;
- b) hefboomcertificaten: certificaten die de prestaties van het onderliggende actief volgen met hefboomeffect;
- c) exotische gedekte warrants: gedekte warrants waarvan de belangrijkste component een combinatie van opties is;
- d) onderhandelbare rechten waarvan de onderliggende waarde een niet-eigenvermogensinstrument is;
- e) investeringscertificaten: certificaten die de prestaties van het onderliggende actief volgen zonder hefboomeffect.

RTS2#3 = SDRV

Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt de volgende methodologie toegepast

voor alle gesecuritiseerde derivaten wordt geacht een liquide markt te bestaan”.

6) Tabel 5.1 wordt vervangen door:

“Tabel 5.1

Rentederivaten — klassen waarvoor geen liquide markt bestaat

Activaklasse – Rentederivaten				
elk contract als bedoeld in bijlage I, deel C, punt 4), van Richtlijn 2014/65/EU waarvan het uiteindelijk onderliggende een obligatie, een lening, een mandje, een portefeuille of een index, met inbegrip van een rente-, obligatie-, lening- of enig ander product is dat de prestaties van een rente, obligatie of lening vertegenwoordigt.				
Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium
Obligatiefutures/-forwards / Future op een obligatiefuture / Forward op een obligatiefuture Future op een obligatie RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FUTR RTS2#16 = BOND of	een obligatiefuture/-forward-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria: Segmenteringscriterium 1 (RTS2#17) — emittent van het onderliggende Segmenteringscriterium 2 (RTS2#18) — looptijd van de onderliggende te leveren obligatie, gedefinieerd als volgt: Kortlopend: de onderliggende te leveren obligatie met een looptijd van tussen 1 en 4 jaar wordt geacht kortlopend te zijn Middellanglopend: de onderliggende te leveren obligatie met een looptijd van tussen 4 en 8 jaar wordt geacht middellanglopend te zijn	5 000 000 EUR	10	wanneer voor een subklasse wordt geacht een liquide markt te bestaan met betrekking tot een specifiek looptijdsegment, en voor de door het volgende looptijdsegment bepaalde subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan, wordt voor het eerste back month-contract twee weken voor het eind van de front month geacht een liquide markt te bestaan

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium
<p>Forward op een obligatie</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = FORW</p> <p>RTS2#16 = BOND</p> <p>of</p> <p>Future op een obligatiefuture</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = FUTR</p> <p>RTS2#16 = BNFD</p> <p>of</p> <p>Forward op een obligatiefuture</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = FORW</p> <p>RTS2#16 = BNFD</p>	<p>Langlopend: de onderliggende te leveren obligatie met een looptijd van tussen 8 en 15 jaar wordt geacht langlopend te zijn</p> <p>Ultralanglopend: de onderliggende te leveren obligatie met een looptijd van meer dan 15 jaar wordt geacht ultralanglopend te zijn</p> <p>Segmenteringscriterium 3 — looptijdsegment van de future, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 3$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 2: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 6$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 3: $6 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 4: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 5: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3$ jaar</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n$ jaar</p>			

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium
Obligatieoptie / Optie op een obligatieoptie / Optie op een obligatiefuture Obligatieoptie Optie op een obligatieoptie RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = OPTN RTS2#16 = BOND of Optie op een obligatieoptie RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = OPTN RTS2#16 = BOND of Optie op een obligatiefuture RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = OPTN RTS2#16 = BNFD	een obligatieoptiesubklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria: Segmenteringscriterium 1 (RTS2#22) — uiteindelijke onderliggende obligatie Segmenteringscriterium 2 (RTS2#8) — looptijdsegment van de optie, gedefinieerd als volgt: Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 3$ maanden Looptijdsegment 2: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 6$ maanden Looptijdsegment 3: $6 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1$ jaar Looptijdsegment 4: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2$ jaar Looptijdsegment 5: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3$ jaar ... Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n$ jaar	5 000 000 EUR	10	

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium
<p>Rentefutures en FRA/ Future op een rentefuture / Forward rate agreement op een rentefuture</p> <p>Future op een rentevoet RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FUTR RTS2#16 = INTR</p> <p>of</p> <p>Forward rate agreement RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FRAS RTS2#16 = INTR</p> <p>of</p> <p>Future op een rentefuture RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FUTR RTS2#16 = IFUT</p> <p>of</p> <p>Forward rate agreement op een rentefuture RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FRAS RTS2#16 = IFUT</p>	<p>een rentefuturesubklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 (RTS2#24) — onderliggende rente</p> <p>Segmenteringscriterium 2 (RTS2#25) — termijn van de onderliggende rente</p> <p>Segmenteringscriterium 3 (RTS2#8) — looptijdsegment van de future, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 3$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 2: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 6$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 3: $6 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 4: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 5: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3$ jaar</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n$ jaar</p>	500 000 000 EUR	10	wanneer voor een subklasse wordt geacht een liquide markt te bestaan met betrekking tot een specifiek looptijdsegment, en voor de door het volgende looptijdsegment bepaalde subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan, wordt voor het eerste back month-contract twee weken voor het eind van de front month geacht een liquide markt te bestaan

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium
Renteopties /Optie op een rentefuture/FRA /Optie op een renteoptie /Optie op een optie op een rentefuture/FRA Optie op een rentefuture/FRA// Optie op een renteoptie RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = OPTN RTS2#16 = IFUT of Renteoptie //Optie op een optie op een rentefuture/FRA RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = OPTN RTS2#16 = INTR	een renteoptiesubklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria: Segmenteringscriterium 1 (RTS2#24) —onderliggende rente Segmenteringscriterium 2 (RTS2#25) — termijn van de onderliggende rente Segmenteringscriterium 3 (RTS2#8) — looptijdsegment van de optie, gedefinieerd als volgt: Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 3$ maanden Looptijdsegment 2: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 6$ maanden Looptijdsegment 3: $6 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1$ jaar Looptijdsegment 4: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2$ jaar Looptijdsegment 5: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3$ jaar ... Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n$ jaar	500 000 000 EUR	10	

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium
Swaptions RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWPT	<p>een swaptionsubklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 (RTS2#16) — onderliggend swaptypetype, gedefinieerd als volgt: fixed-to-fixed single currency swap, futures/forwards op fixed-to-fixed single currency swap [RTS2#16 = XXSC]</p> <p>fixed-to-float single currency swap, futures/forwards op fixed-to-float single currency swap [RTS2#16 = XFSC]</p> <p>float-to-float single currency swap, futures/forwards op float-to-float single currency swap [RTS2#16 = FFSC]</p> <p>inflation single currency swap, futures/forwards op inflation single currency swap [RTS2#16 = IFSC]</p> <p>OIS single currency swap, futures/forwards op OIS single currency swap [RTS2#16 = OSSC]</p> <p>fixed-to-fixed multi-currency swap, futures/forwards op fixed-to-fixed multi-currency swap [RTS2#16 = XXMC]</p> <p>fixed-to-float multi-currency swap, futures/forwards op fixed-to-float multi-currency swap [RTS2#16 = XFMC]</p>	500 000 000 EUR	10	

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium
	<p>float-to-float multi-currency swap, futures/forwards op float-to-float multi-currency swap [RTS2#16 = FPMC]</p> <p>inflation multi-currency swap, futures/forwards op inflation multi-currency swap [RTS2#16 = IFMC]</p> <p>OIS multi-currency swap, futures/forwards op OIS multi-currency swap [RTS2#16 = OSMC]</p> <p>Segmenteringscriterium 2 (RTS2#20) — notionele valuta, gedefinieerd als de valuta waarin de notionele waarde van de optie is uitgedrukt</p> <p>Segmenteringscriterium 3 (RTS2#22 of RTS2#23) — inflatie-index indien het onderliggende swaptype ofwel een inflation single currency swap, ofwel een inflation multi-currency swap is</p> <p>Segmenteringscriterium 4 (RTS2#21) — looptijdsegment van de swap, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1$ maand</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ maand} < \text{looptijd} \leq 3$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 6$ maanden</p>			

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium
	<p>Looptijdsegment 4: 6 maanden < looptijd ≤ 1 jaar</p> <p>Looptijdsegment 5: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar</p> <p>Looptijdsegment 6: 2 jaar < looptijd ≤ 3 jaar</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar</p> <p>Segmenteringscriterium 5 (RTS2#8) — looptijdsegment van de optie, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 6 maanden</p> <p>Looptijdsegment 2: 6 maanden < looptijd ≤ 1 jaar</p> <p>Looptijdsegment 3: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar</p> <p>Looptijdsegment 4: 2 jaar < looptijd ≤ 5 jaar</p> <p>Looptijdsegment 5: 5 jaar < looptijd ≤ 10 jaar</p> <p>Looptijdsegment 6: langer dan 10 jaar</p>			

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium
<p>Fixed-to-Float “multi-currency swaps” of “cross-currency swaps” en futures/forwards op Fixed-to-Float “multi-currency swaps” of “cross-currency swaps”</p> <p>een swap of een future/forward/optie op een swap waarbij twee partijen in verschillende valuta's luidende kasstromen uitwisselen en de kasstromen aan de ene zijde worden bepaald door een vaste rente, terwijl die aan de andere zijde worden bepaald door een zwevende rente</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP of FONS of FWOS of OPTS</p> <p>RTS2#16 = XFMC</p>	<p>een fixed-to-float multi-currency-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 (RTS23#13 en RTS23#42) — notioneel valutapaar, gedefinieerd als de combinatie van de twee valuta's waarin de twee zijden van de swap zijn uitgedrukt</p> <p>Segmenteringscriterium 2 (RTS2#8) — looptijdsegment van de swap, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1$ maand</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ maand} < \text{looptijd} \leq 3$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 6$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 4: $6 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 5: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 6: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3$ jaar</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n$ jaar</p>	50 000 000 EUR	10	

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium
<p>Float-to-Float “multi-currency swaps” of “cross-currency swaps” en futures/forwards/opties op Float-to-Float “multi-currency swaps” of “cross-currency swaps”</p> <p>een swap of een future/forward/optie op een swap waarbij twee partijen in verschillende valuta's luidende kasstromen uitwisselen en de kasstromen aan beide zijden worden bepaald door een zwerende rente</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP of FONS of FWOS of OPTS</p> <p>RTS2#16 = FFMC</p>	<p>een float-to-float multi-currency-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 (RTS23#13 en RTS23#42) — notioneel valutapaar, gedefinieerd als de combinatie van de twee valuta's waarin de twee zijden van de swap zijn uitgedrukt</p> <p>Segmenteringscriterium 2 (RTS2#8) — looptijdsegment van de swap, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1$ maand</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ maand} < \text{looptijd} \leq 3$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 6$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 4: $6 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 5: $1 \text{ year} < \text{maturity} \leq 2 \text{ years}$</p> <p>Looptijdsegment 6: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3 \text{ jaar}$</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n \text{ jaar}$</p>	50 000 000 EUR	10	

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium
<p>Fixed-to-Fixed “multi-currency swaps” of “cross-currency swaps” en futures/forwards/opties op Fixed-to-Fixed “multi-currency swaps” of “cross-currency swaps”</p> <p>een swap of een future/forward/optie op een swap waarbij twee partijen in verschillende valuta's luidende kasstromen uitwisselen en de kasstromen aan beide zijden worden bepaald door een zware rente</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP of FONS of FWOS of OPTS</p> <p>RTS2#16 = XXMC</p>	<p>een fixed-to-fixed multi-currency-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 (RTS23#13 en RTS23#42) — notioneel valutapaar, gedefinieerd als de combinatie van de twee valuta's waarin de twee zijden van de swap zijn uitgedrukt</p> <p>Segmenteringscriterium 2 (RTS2#8) — looptijdsegment van de swap, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1$ maand</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ maand} < \text{looptijd} \leq 3$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 6$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 4: $6 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 5: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 6: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3$ jaar</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n$ jaar</p>	50 000 000 EUR	10	

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium
<p>Overnight Index Swap (OIS) “multi-currency swaps” of “cross-currency swaps” en futures/forwards/opties op Overnight Index Swap (OIS) “multi-currency swaps” of “cross-currency swaps”</p> <p>een swap of een future/forward/optie op een swap waarbij twee partijen in verschillende valuta's luidende kasstromen uitwisselen en de kasstromen aan ten minste één zijde worden bepaald door een Overnight Index Swap (OIS)-rente</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP of FONS of FWOS of OPTS</p> <p>RTS2#16 = OSMC</p>	<p>een Overnight Index Swap (OIS) multi-currency-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 (RTS23#13 en RTS23#42) — notioneel valutapaar, gedefinieerd als de combinatie van de twee valuta's waarin de twee zijden van de swap zijn uitgedrukt</p> <p>Segmenteringscriterium 2 (RTS2#8) — looptijdsegment van de swap, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1$ maand</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ maand} < \text{looptijd} \leq 3$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 6$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 4: $6 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 5: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 6: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3$ jaar</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n$ jaar</p>	50 000 000 EUR	10	

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium
<p>Inflation “multi-currency swaps” of “cross-currency swaps” en futures/forwards/opties op Inflation “multi-currency swaps” of “cross-currency swaps”</p> <p>een swap of een future/forward/optie op een swap waarbij twee partijen in verschillende valuta's luidende kasstromen uitwisselen en de kasstromen aan ten minste één zijde worden bepaald door een inflatierente</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP of FONS of FWOS of OPTS</p> <p>RTS2#16 = IFMC</p>	<p>een inflation multi-currency-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 (RTS23#13 en RTS23#42) — notioneel valutapaar, gedefinieerd als de combinatie van de twee valuta's waarin de twee zijden van de swap zijn uitgedrukt</p> <p>Segmenteringscriterium 2 (RTS2#8) — looptijdsegment van de swap, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1$ maand</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ maand} < \text{looptijd} \leq 3$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 6$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 4: $6 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 5: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 6: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3$ jaar</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n$ jaar</p>	50 000 000 EUR	10	

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium
<p>Fixed-to-Float “single currency swaps” en futures/forwards/opties op Fixed-to-Float “single currency swaps”</p> <p>een swap of een future/forward/optie op een swap waarbij twee partijen in dezelfde valuta luidende kasstromen uitwisselen en de kasstromen aan de ene zijde worden bepaald door een vaste rente, terwijl die aan de andere zijde worden bepaald door een zwevende rente</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP of FONS of FWOS of OPTS</p> <p>RTS2#16 = XFSC</p>	<p>een fixed-to-float single currency-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 (RTS23#13) — notionele valuta waarin de twee zijden van de swap zijn uitgedrukt</p> <p>Segmenteringscriterium 2 (RTS2#8) — looptijdsegment van de swap, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1$ maand</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ maand} < \text{looptijd} \leq 3$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 6$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 4: $6 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 5: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 6: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3$ jaar</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n$ jaar</p>	50 000 000 EUR	10	

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium
<p>Float-to-Float “single currency swaps” en futures/forwards/opties op Float-to-Float “single currency swaps”</p> <p>een swap of een future/forward/optie op een swap waarbij twee partijen in dezelfde valuta luidende kasstromen uitwisselen en de kasstromen aan beide zijden worden bepaald door een zwevende rente</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP of FONS of FWOS of OPTS</p> <p>RTS2#16 = FFSC</p>	<p>een fixed-to-float single currency-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 (RTS2#13) — notionele valuta waarin de twee zijden van de swap zijn uitgedrukt</p> <p>Segmenteringscriterium 2 (RTS2#8) — looptijdsegment van de swap, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1$ maand</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ maand} < \text{looptijd} \leq 3$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 6$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 4: $6 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 5: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 6: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3$ jaar</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n$ jaar</p>	50 000 000 EUR	10	

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium
<p>Fixed-to-Fixed “single currency swaps” en futures/forwards/opties op Fixed-to-Fixed “single currency swaps”</p> <p>een swap of een future/forward/optie op een swap waarbij twee partijen in dezelfde valuta luidende kasstromen uitwisselen en de kasstromen aan beide zijden worden bepaald door een vaste rente</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP of FONS of FWOS of OPTS</p> <p>RTS2#16 = XXSC</p>	<p>een fixed-to-fixed single currency-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 (RTS2#13) — notionele valuta waarin de twee zijden van de swap zijn uitgedrukt</p> <p>Segmenteringscriterium 2 (RTS2#8) — looptijdsegment van de swap, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1$ maand</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ maand} < \text{looptijd} \leq 3$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 6$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 4: $6 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 5: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 6: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3$ jaar</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n$ jaar</p>	50 000 000 EUR	10	

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gsegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium
<p>Overnight Index Swap (OIS) “single currency swaps” en futures/forwards/opties op Overnight Index Swap (OIS) “single currency swaps”</p> <p>een swap of een future/forward/optie op een swap waarbij twee partijen in dezelfde valuta luidende kasstromen uitwisselen en de kasstromen aan ten minste één zijde worden bepaald door een Overnight Index Swap (OIS)-rente</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP of FONS of FWOS of OPTS</p> <p>RTS2#16 = OSSC</p>	<p>een Overnight Index Swap (OIS) single currency-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 (RTS23#13) — notionele valuta waarin de twee zijden van de swap zijn uitgedrukt</p> <p>Segmenteringscriterium 2 (RTS2#8) — looptijdsegment van de swap, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1$ maand</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ maand} < \text{looptijd} \leq 3$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 6$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 4: $6 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 5: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 6: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3$ jaar</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n$ jaar</p>	50 000 000 EUR	10	

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium
<p>Inflation “single currency swaps” en futures/forwards/opties op Inflation “single currency swaps”</p> <p>een swap of een future/forward/optie op een swap waarbij twee partijen in dezelfde valuta luidende kasstromen uitwisselen en de kasstromen aan ten minste één zijde worden bepaald door een inflatierente</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP of FONS of FWOS of OPTS</p> <p>RTS2#16 = IFSC</p>	<p>een inflation single currency-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 (RTS23#13) — notionele valuta waarin de twee zijden van de swap zijn uitgedrukt</p> <p>Segmenteringscriterium 2 (RTS2#8) — looptijdsegment van de swap, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1$ maand</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ maand} < \text{looptijd} \leq 3$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 6$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 4: $6 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 5: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 6: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3$ jaar</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n$ jaar</p>	50 000 000 EUR	10	

Activaklasse — Rentederivaten	
Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt de volgende methodologie toegepast
<p>Overige rentederivaten</p> <p>een rentederivaat dat niet tot een van bovengenoemde subactivaklassen behoort</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = OTHR</p>	Voor alle overige rentederivaten wordt geacht geen liquide markt te bestaan”.

7) Tabel 6.1 wordt vervangen door:

“Tabel 6.1

Aandelenderivaten — klassen waarvoor geen liquide markt bestaat

Activaklasse — Aandelenderivaten

elk contract als bedoeld in bijlage I, deel C, punt 4), van Richtlijn 2014/65/EU met betrekking tot:

- een of meer aandelen, representatieve certificaten, ETF's, certificaten, andere soortgelijke financiële instrumenten, kasstromen of andere producten die zijn gekoppeld aan de prestaties van een of meer aandelen, representatieve certificaten, ETF's, certificaten of andere soortgelijke financiële instrumenten;
- een index van aandelen, representatieve certificaten, ETF's, certificaten, andere soortgelijke financiële instrumenten, kasstromen of andere producten die zijn gekoppeld aan de prestaties van een of meer aandelen, representatieve certificaten, ETF's, certificaten of andere soortgelijke financiële instrumenten

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt de volgende methodologie toegepast
<p>Aandelenindexopties</p> <p>een optie waarvan het onderliggende actief een uit aandelen samengestelde index is</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = STIX</p> <p>RTS23#26 of, indien nihil, RTS23#28</p>	<p>voor alle indexopties wordt geacht een liquide markt te bestaan</p>
<p>Aandelenindexfutures/-forwards</p> <p>een future/forward waarvan het onderliggende actief een uit aandelen samengestelde index is</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR of FORW</p> <p>RTS2#27 = STIX</p> <p>RTS23#26 of, indien nihil, RTS23#28</p>	<p>voor alle indexfutures/-forwards wordt geacht een liquide markt te bestaan</p>
<p>Aandelenopties</p> <p>een optie waarvan het onderliggende actief een aandeel of een uit een bedrijfsmaatregel resulterend mandje van aandelen is</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = SHRS</p> <p>RTS23#26 of, indien nihil, RTS23#28</p>	<p>voor alle aandelenopties wordt geacht een liquide markt te bestaan</p>

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt de volgende methodologie toegepast
<p>Aandelenfutures/-forwards</p> <p>een future/forward waarvan het onderliggende actief een aandeel of een uit een bedrijfsmaatregel resulterend mandje van aandelen is</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR of FORW</p> <p>RTS2#27 = SHRS</p> <p>RTS23#26 of, indien nihil, RTS23#28</p>	<p>voor alle aandelenfutures/-forwards wordt geacht een liquide markt te bestaan</p>
<p>Aandelendividendopties</p> <p>een optie op het dividend van een specifiek aandeel</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = DVSE</p> <p>RTS23#26 of, indien nihil, RTS23#28</p>	<p>voor alle aandelendividendopties wordt geacht een liquide markt te bestaan</p>
<p>Aandelendividendfutures/-forwards</p> <p>een future/forward op het dividend van een specifiek aandeel</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR of FORW</p> <p>RTS2#27 = DVSE</p> <p>RTS23#26 of, indien nihil, RTS23#28</p>	<p>voor alle aandelenfutures/-forwards wordt geacht een liquide markt te bestaan</p>

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt de volgende methodologie toegepast
<p>Dividendindexopties</p> <p>een optie op een index die is samengesteld uit dividenden van meer dan één aandeel</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = DIVI</p> <p>RTS23#26 of, indien nihil, RTS23#28</p>	<p>voor alle dividendindexopties wordt geacht een liquide markt te bestaan</p>
<p>Dividendindexfutures/-forwards</p> <p>een future/forward op een index die is samengesteld uit dividenden van meer dan één aandeel</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR of FORW</p> <p>RTS2#27 = DIVI</p> <p>RTS23#26 of, indien nihil, RTS23#28</p>	<p>voor alle dividendindexfutures/-forwards wordt geacht een liquide markt te bestaan</p>
<p>Volatiliteitsindexopties</p> <p>een optie waarvan het onderliggende een volatiliteitsindex is, gedefinieerd als een index die is gekoppeld aan de volatiliteit van een specifieke onderliggende index van eigenvermogensinstrumenten</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = VOLI</p> <p>RTS23#26 of, indien nihil, RTS23#28</p>	<p>voor alle volatiliteitsindexopties wordt geacht een liquide markt te bestaan</p>

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt de volgende methodologie toegepast
<p>Volatiliteitsindexfutures/-forwards</p> <p>een future/forward waarvan het onderliggende een volatiliteitsindex is, gedefinieerd als een index die is gekoppeld aan de volatiliteit van een specifieke onderliggende index van eigenvermogensinstrumenten</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR of FORW</p> <p>RTS2#27 = VOLI</p> <p>RTS23#26 of, indien nihil, RTS23#28</p>	<p>voor alle volatiliteitsindexfutures/-forwards wordt geacht een liquide markt te bestaan</p>
<p>ETF-opties</p> <p>een optie waarvan het onderliggende actief een ETF is</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = ETFS</p> <p>RTS23#26 of, indien nihil, RTS23#28</p>	<p>voor alle ETF-opties wordt geacht een liquide markt te bestaan</p>
<p>ETF-futures/-forwards</p> <p>een future/forward waarvan het onderliggende actief een ETF is</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = FUTR of FORW</p> <p>RTS2#27 = ETFS</p> <p>RTS23#26 of, indien nihil, RTS23#28</p>	<p>voor alle ETF-futures/-forwards wordt geacht een liquide markt te bestaan</p>

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria			
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]		
Swaps RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = SWAP	een swapsubklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria: Segmenteringscriterium 1 (RTS2#27) — onderliggend type: single name, index, mandje Segmenteringscriterium 2 (RTS23#26 of, indien nihil, RTS23#28) — onderliggend(e) single name, index, mandje Segmenteringscriterium 3 (RTS2#28) — parameter: price return basic performance parameter, parameter return dividend, parameter return variance, parameter return volatility Segmenteringscriterium 4 (RTS2#8) — looptijdsegment van de swap, gedefinieerd als volgt:			50 000 000 EUR	
	Price return basic performance parameter	Parameter return variance/volatility	Parameter return dividend		
	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 1 maand	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 3 maanden	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 1 jaar		
	Looptijdsegment 2: 1 maand < looptijd ≤ 3 maanden	Looptijdsegment 2: 3 maanden < looptijd ≤ 6 maanden	Looptijdsegment 2: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar		
	Looptijdsegment 3: 3 maanden < looptijd ≤ 6 maanden	Looptijdsegment 3: 6 maanden < looptijd ≤ 1 jaar	Looptijdsegment 3: 2 jaar < looptijd ≤ 3 jaar		
	Looptijdsegment 4: 6 maanden < looptijd ≤ 1 jaar	Looptijdsegment 4: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar	...		

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven			Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria	
				Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
	Looptijdsegment 5: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar	Looptijdsegment 5: 2 jaar < looptijd ≤ 3 jaar	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar		
	Looptijdsegment 6: 2 jaar < looptijd ≤ 3 jaar	...			
	...	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar			
	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar				
Portefeuilleswaps RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = PSWP	een portefeuilleswap-subklasse wordt gedefinieerd door een specifieke combinatie van: Segmenteringscriterium 1 (RTS2#27) — onderliggend type: single name, index, mandje Segmenteringscriterium 2 (RTS23#26 of, indien nihil, RTS23#28) — onderliggend(e) single name, index, mandje Segmenteringscriterium 3 (RTS2#28) — parameter: price return basic performance parameter, parameter return dividend, parameter return variance, parameter return volatility Segmenteringscriterium 4 (RTS2#8) — looptijdsegment van de portefeuilleswap, gedefinieerd als volgt: Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 1 maand Looptijdsegment 2: 1 maand < looptijd ≤ 3 maanden Looptijdsegment 3: 3 maanden < looptijd ≤ 6 maanden Looptijdsegment 4: 6 maanden < looptijd ≤ 1 jaar Looptijdsegment 5: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar Looptijdsegment 6: 2 jaar < looptijd ≤ 3 jaar ... Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar			50 000 000 EUR	15

Activaklasse — Aandelenderivaten

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt de volgende methodologie toegepast
<p>Overige aandelenderivaten een aandelenderivaat dat niet tot een van bovengenoemde subactivaklassen behoort</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OTHR</p>	<p>Voor alle overige aandelenderivaten wordt geacht geen liquide markt te bestaan”.</p>

8) Tabel 7.1 wordt vervangen door:

“Tabel 7.1

Grondstoffenderivaten – klassen waarvoor geen liquide markt bestaat

Activaklasse — Grondstoffenderivaten				
Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	
Metaalfutures/-forwards RTS2#3 = “DERV” en RTS2#4 = “COMM” en RTS23#35 = “METL” en [RTS2#5 = “FUTR” of “FORW”]	een metaalfuture/-forward-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria: Segmenteringscriterium 1 (RTS23#36) — metaaltype: edelmetaal, niet-edelmetaal Segmenteringscriterium 2 (RTS23#37) — onderliggend metaal Segmenteringscriterium 3 (RTS2#15) — notionele valuta, gedefinieerd als de valuta waarin de notionele waarde van de future/forward is uitgedrukt Segmenteringscriterium 4 (RTS2#8) — looptijdsegment van de future/forward, gedefinieerd als volgt:		10 000 000 EUR	10
	Edelmetalen	Niet-edelmetalen		
	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 3 maanden	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 1 jaar		
	Looptijdsegment 2: 3 maanden < looptijd ≤ 1 jaar	Looptijdsegment 2: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar		
	Looptijdsegment 3: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar	Looptijdsegment 3: 2 jaar < looptijd ≤ 3 jaar		

Activaklasse — Grondstoffenderivaten

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven		Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels	
			Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
	Looptijdsegment 4: 2 jaar < looptijd ≤ 3 jaar	...		
	...	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar		
	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar			
Metaalopties RTS2#3 = “DERV” en RTS2#4 = “COMM” en RTS23#35 = “METL” en RTS2#5 = “OPTN”	een metaaloptiesubklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria: Segmenteringscriterium 1 (RTS23#36) — metaaltype: edelmetaal, niet-edelmetaal Segmenteringscriterium 2 (RTS23#37) — onderliggend metaal Segmenteringscriterium 3 (RTS2#15) — notionele valuta, gedefinieerd als de valuta waarin de notionele waarde van de optie is uitgedrukt Segmenteringscriterium 4 (RTS2#8) — looptijdsegment van de optie, gedefinieerd als volgt:		10 000 000 EUR	10
	Edelmetalen	Niet-edelmetalen		
	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 3 maanden	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 1 jaar		
	Looptijdsegment 2: 3 maanden < looptijd ≤ 1 jaar	Looptijdsegment 2: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar		

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven		Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels	
			Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
	Looptijdsegment 3: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar	Looptijdsegment 3: 2 jaar < looptijd ≤ 3 jaar		
	Looptijdsegment 4: 2 jaar < looptijd ≤ 3 jaar	...		
	...	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar		
	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar			
Metaalswaps RTS2#3 = “DERV” en RTS2#4 = “COMM” en RTS23#35 = “METL” en RTS2#5 = “SWAP”	een metaalswapsubklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria: Segmenteringscriterium 1 (RTS23#36) — metaaltype: edelmetaal, niet-edelmetaal Segmenteringscriterium 2 (RTS23#37) — onderliggend metaal Segmenteringscriterium 3 (RTS2#15) — notionele valuta, gedefinieerd als de valuta waarin de notionele waarde van de swap is uitgedrukt Segmenteringscriterium 4 (RTS23#34) — afwikkelingstype, gedefinieerd als contanten, fysiek of anders Segmenteringscriterium 5 (RTS2#8) — looptijdsegment van de swap, gedefinieerd als volgt:		10 000 000 EUR	10
	Edelmetalen	Niet-edelmetalen		
	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 3 maanden	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 1 jaar		

Activaklasse — Grondstoffenderivaten

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven		Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels	
			Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
	Looptijdsegment 2: 3 maanden < looptijd ≤ 1 jaar	Looptijdsegment 2: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar		
	Looptijdsegment 3: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar	Looptijdsegment 3: 2 jaar < looptijd ≤ 3 jaar		
	Looptijdsegment 4: 2 jaar < looptijd ≤ 3 jaar	...		
	...	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar		
	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar			
Energiefutures/-forwards RTS2#3 = “DERV” en RTS2#4 = “COMM” en RTS23#35 = “NRGY” en [RTS2#5 = “FUTR” of “FORW”]	een energiefuture/-forward-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria: Segmenteringscriterium 1 (RTS23#36) — energietype: olie, destillaten, kolen, lichte eindfracties, aardgas, elektriciteit, Inter Energy Segmenteringscriterium 2 (RTS23#37) — onderliggende energie Segmenteringscriterium 3 (RTS2#15) — notionele valuta, gedefinieerd als de valuta waarin de notionele waarde van de future/forward is uitgedrukt Segmenteringscriterium 4 — [geschrapt]		10 000 000 EUR	10

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels																						
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]																					
	<p>Segmenteringscriterium 5 (RTS2#14) — locatie van levering/afwikkeling in contanten van toepassing op alle energietypen</p> <p>Segmenteringscriterium 6 (RTS2#8) — looptijdsegment van de future/forward, gedefinieerd als volgt:</p>																							
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>Olie/Destillaten/Lichte eindfracties</th> <th>Kolen</th> <th>Aardgas/Elektriciteit/Inter Energy</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 4 maanden</td> <td>Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 6 maanden</td> <td>Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 1 maand</td> </tr> <tr> <td>Looptijdsegment 2: 4 maanden < looptijd ≤ 8 maanden</td> <td>Looptijdsegment 2: 6 maanden < looptijd ≤ 1 jaar</td> <td>Looptijdsegment 2: 1 maand < looptijd ≤ 1 jaar</td> </tr> <tr> <td>Looptijdsegment 3: 8 maanden < looptijd ≤ 1 jaar</td> <td>Looptijdsegment 3: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar</td> <td>Looptijdsegment 3: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar</td> </tr> <tr> <td>Looptijdsegment 4: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar</td> <td>...</td> <td>...</td> </tr> <tr> <td>...</td> <td>Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar</td> <td>Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar</td> </tr> <tr> <td>Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar</td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>	Olie/Destillaten/Lichte eindfracties	Kolen	Aardgas/Elektriciteit/Inter Energy	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 4 maanden	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 6 maanden	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 1 maand	Looptijdsegment 2: 4 maanden < looptijd ≤ 8 maanden	Looptijdsegment 2: 6 maanden < looptijd ≤ 1 jaar	Looptijdsegment 2: 1 maand < looptijd ≤ 1 jaar	Looptijdsegment 3: 8 maanden < looptijd ≤ 1 jaar	Looptijdsegment 3: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar	Looptijdsegment 3: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar	Looptijdsegment 4: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar				
Olie/Destillaten/Lichte eindfracties	Kolen	Aardgas/Elektriciteit/Inter Energy																						
Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 4 maanden	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 6 maanden	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 1 maand																						
Looptijdsegment 2: 4 maanden < looptijd ≤ 8 maanden	Looptijdsegment 2: 6 maanden < looptijd ≤ 1 jaar	Looptijdsegment 2: 1 maand < looptijd ≤ 1 jaar																						
Looptijdsegment 3: 8 maanden < looptijd ≤ 1 jaar	Looptijdsegment 3: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar	Looptijdsegment 3: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar																						
Looptijdsegment 4: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar																						
...	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar																						
Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar																								

Activaklasse — Grondstoffenderivaten

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels			
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]		
Energieopties RTS2#3 = “DERV” en RTS2#4 = “COMM” en RTS23#35 = “NRGY” en RTS2#5 = “OPTN”	een energieoptiesubklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria: Segmenteringscriterium 1 (RTS23#36) — energietype: olie, destillaten, kolen, lichte eindfracties, aardgas, elektriciteit, Inter Energy Segmenteringscriterium 2 (RTS23#37) — onderliggende energie Segmenteringscriterium 3 (RTS2#15) — notionele valuta, gedefinieerd als de valuta waarin de notionele waarde van de optie is uitgedrukt Segmenteringscriterium 4 — [geschrapt] Segmenteringscriterium 5 (RTS2#14) — locatie van levering/afwikkeling in contanten van toepassing op alle energietypen Segmenteringscriterium 6 (RTS2#8) — looptijdsegment van de optie, gedefinieerd als volgt:		10 000 000 EUR	10	
	Olie/Destillaten/Lichte eindfracties	Kolen			Aardgas/Electriciteit/Inter Energy
	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 4 maanden	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 6 maanden			Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 1 maand
	Looptijdsegment 2: 4 maanden < looptijd ≤ 8 maanden	Looptijdsegment 2: 6 maanden < looptijd ≤ 1 jaar			Looptijdsegment 2: 1 maand < looptijd ≤ 1 jaar
	Looptijdsegment 3: 8 maanden < looptijd ≤ 1 jaar	Looptijdsegment 3: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar			Looptijdsegment 3: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar

Activaklasse — Grondstoffenderivaten

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven			Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels	
				Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
	Looptijdsegment 4: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar		
	...	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar		
	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar				
Energieswaps RTS2#3 = “DERV” en RTS2#4 = “COMM” en RTS23#35 = “NRGY” en RTS2#5 = “SWAP”	<p>een energieswapsubklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 (RTS23#36) — energietype: olie, destillaten, kolen, lichte eindfracties, aardgas, elektriciteit, Inter Energy</p> <p>Segmenteringscriterium 2 (RTS23#37) — onderliggende energie</p> <p>Segmenteringscriterium 3 (RTS2#15) — notionele valuta, gedefinieerd als de valuta waarin de notionele waarde van de optie is uitgedrukt</p> <p>Segmenteringscriterium 4 (RTS23#34) — afwikkelingstype, gedefinieerd als contanten, fysiek of anders</p> <p>Segmenteringscriterium 5 — [geschrapt]</p> <p>Segmenteringscriterium 6 (RTS2#14) — locatie van levering/afwikkeling in contanten van toepassing op alle energietypen</p> <p>Segmenteringscriterium 7 (RTS2#8) — looptijdsegment van de swap, gedefinieerd als volgt:</p>			10 000 000 EUR	10

Activaklasse — Grondstoffenderivaten

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven			Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels	
				Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
	Olie/Destillaten/Lichte eindfracties	Kolen	Aardgas/Elektriciteit/Inter Energy		
	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 4 maanden	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 6 maanden	Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 1 maand		
	Looptijdsegment 2: 4 maanden < looptijd ≤ 8 maanden	Looptijdsegment 2: 6 maanden < looptijd ≤ 1 jaar	Looptijdsegment 2: 1 maand < looptijd ≤ 1 jaar		
	Looptijdsegment 3: 8 maanden < looptijd ≤ 1 jaar	Looptijdsegment 3: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar	Looptijdsegment 3: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar		
	Looptijdsegment 4: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar		
	...	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar		
	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar				
Landbouwgrondstoffen-futures/-forwards RTS2#3 = “DERV” en RTS2#4 = “COMM” en RTS23#35 = “AGRI” en [RTS2#5 = “FUTR” of “FORW”]	een landbouwgrondstoffenfuture/-forward-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria: Segmenteringscriterium 1 (RTS23#36 en RTS23#37) — onderliggende landbouwgrondstof (subproduct en verder subproduct) Segmenteringscriterium 2 (RTS2#15) — notionele valuta, gedefinieerd als de valuta waarin de notionele waarde van de future/forward is uitgedrukt			10 000 000 EUR	10

Activaklasse — Grondstoffenderivaten

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels	
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
	<p>Segmenteringscriterium 3 (RTS2#8) — looptijdsegment van de future/forward, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 3$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 2: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 6$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 3: $6 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 4: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2$ jaar</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n$ jaar</p>		
<p>Landbouwgrondstoffen-opties</p> <p>RTS2#3 = “DERV” en RTS2#4 = “COMM” en RTS23#35 = “AGRI” en RTS2#5 = “OPTN”</p>	<p>een landbouwgrondstoffenoptie-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 (RTS23#36 en RTS23#37) — onderliggende landbouwgrondstof (sub-product en verder subproduct)</p> <p>Segmenteringscriterium 2 (RTS2#15) — notionele valuta, gedefinieerd als de valuta waarin de notionele waarde van de optie is uitgedrukt</p> <p>Segmenteringscriterium 3 (RTS2#8) — looptijdsegment van de optie, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 3$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 2: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 6$ maanden</p> <p>Looptijdsegment 3: $6 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1$ jaar</p>	10 000 000 EUR	10

Activaklasse — Grondstoffenderivaten

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels	
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
	<p>Looptijdsegment 4: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar</p>		
<p>Landbouwgrondstoffenswaps</p> <p>RTS2#3 = “DERV” en RTS2#4 = “COMM” en RTS23#35 = “AGRI” en RTS2#5 = “SWAP”</p>	<p>een landbouwgrondstoffenswap-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 (RTS23#36 en RTS23#37) — onderliggende landbouwgrondstof (subproduct en verder subproduct)</p> <p>Segmenteringscriterium 2 (RTS2#15) — notionele valuta, gedefinieerd als de valuta waarin de notionele waarde van de optie is uitgedrukt</p> <p>Segmenteringscriterium 3 (RTS23#34) — afwikkelingstype, gedefinieerd als contanten, fysiek of anders</p> <p>Segmenteringscriterium 4 (RTS2#8) — looptijdsegment van de swap, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 3 maanden</p> <p>Looptijdsegment 2: 3 maanden < looptijd ≤ 6 maanden</p> <p>Looptijdsegment 3: 6 maanden < looptijd ≤ 1 jaar</p> <p>Looptijdsegment 4: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar</p>	10 000 000 EUR	10

Activaklasse — Grondstoffenderivaten			
Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels	
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
	... Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar		
Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt de volgende methodologie toegepast		
Overige grondstoffenderivaten een grondstoffenderivaat dat niet tot een van bovengenoemde subactivaklassen behoort	Voor alle overige grondstoffenderivaten wordt geacht geen liquide markt te bestaan”.		

9) Tabel 8.1 wordt vervangen door:

“Tabel 8.1

Valutaderivaten – klassen waarvoor geen liquide markt bestaat

Activaklasse — Valutaderivaten			
een financieel instrument dat verband houdt met valuta's als omschreven in deel C, punt 4), van bijlage I bij Richtlijn 2014/65/EU			
Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria	
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
<p>Niet-leverbare forward (NDF)</p> <p>een forward die, zoals vastgelegd in de voorwaarden ervan, in contanten wordt afgewikkeld tussen de tegenpartijen, waarbij het afwikkelingsbedrag wordt bepaald door het verschil in de wisselkoers van twee valuta's tussen de transactiedatum en de waarderingsdatum. Op de afwikkelingsdatum zal de ene partij de andere partij het nettoverschil tussen i) de wisselkoers op de transactiedatum en ii) de wisselkoers op de waarderingsdatum verschuldigd zijn, op basis van de notionele waarde, welk nettobedrag wordt betaald in de in het contract vastgelegde afwikkelingsvaluta.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = FORW</p> <p>RTS2#26 = NDLV</p>	<p>Een niet-leverbare valutaforwardsubklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 RTS23#13 en RTS23#47 — onderliggend valutapaar, gedefinieerd als combinatie van de twee onderliggende valuta's van het derivatencontract</p> <p>Segmenteringscriterium 2 RTS2#8 — looptijdsegment van de forward, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1 \text{ week}$</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ week} < \text{looptijd} \leq 3 \text{ maanden}$</p> <p>Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1 \text{ jaar}$</p> <p>Looptijdsegment 4: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2 \text{ jaar}$</p> <p>Looptijdsegment 5: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3 \text{ jaar}$</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n \text{ jaar}$</p>	<p>Voor niet-leverbare forwards (NDF's) wordt geacht geen liquide markt te bestaan</p>	

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria	
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
<p>Leverbare forward (DF)</p> <p>een forward die uitsluitend de uitwisseling van twee verschillende valuta's op een specifieke, in het contract vastgelegde toekomstige afwikkelingsdatum omvat, tegen een vaste koers zoals overeengekomen bij het sluiten van het uitwisselingscontract.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = FORW</p> <p>RTS2#26 = DLVB</p>	<p>Een leverbare valutaforwardsubklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 RTS23#13 en RTS23#47 — onderliggend valutapaar, gedefinieerd als combinatie van de twee onderliggende valuta's van het derivatencontract</p> <p>Segmenteringscriterium 2 RTS2#8 — looptijdsegment van de forward, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1 \text{ week}$</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ week} < \text{looptijd} \leq 3 \text{ maanden}$</p> <p>Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1 \text{ jaar}$</p> <p>Looptijdsegment 4: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2 \text{ jaar}$</p> <p>Looptijdsegment 5: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3 \text{ jaar}$</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n \text{ jaar}$</p>	<p>Voor leverbare forwards (DF's) wordt geacht geen liquide markt te bestaan</p>	

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria	
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
<p>Niet-leverbare valutaopties (NDO)</p> <p>een optie die, zoals vastgelegd in de voorwaarden ervan, in contanten wordt afgewikkeld tussen de tegenpartijen, waarbij het afwikkelingsbedrag wordt bepaald door het verschil in de wisselkoers van twee valuta's tussen de transactiedatum en de waarderingsdatum. Op de afwikkelingsdatum zal de ene partij de andere partij het nettoverschil tussen i) de wisselkoers op de transactiedatum en ii) de wisselkoers op de waarderingsdatum verschuldigd zijn, op basis van de notionele waarde, welk nettobedrag wordt betaald in de in het contract vastgelegde afwikkelingsvaluta.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#26 = NDLV</p>	<p>Een niet-leverbare-valutaoptiesubklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 RTS23#13 en RTS23#47 — onderliggend valutapaar, gedefinieerd als combinatie van de twee onderliggende valuta's van het derivatencontract</p> <p>Segmenteringscriterium 2 RTS2#8 — looptijdsegment van de optie, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1 \text{ week}$</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ week} < \text{looptijd} \leq 3 \text{ maanden}$</p> <p>Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1 \text{ jaar}$</p> <p>Looptijdsegment 4: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2 \text{ jaar}$</p> <p>Looptijdsegment 5: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3 \text{ jaar}$</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n \text{ jaar}$</p>	<p>Voor niet-leverbare valutaopties (NDO's) wordt geacht geen liquide markt te bestaan</p>	

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria	
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
<p>Leverbare valutaopties (DO)</p> <p>een optie die uitsluitend de uitwisseling van twee verschillende valuta's op een specifieke, in het contract vastgelegde toekomstige afwikkelingsdatum omvat, tegen een vaste koers zoals overeengekomen bij het sluiten van het uitwisselingscontract</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#26 = DLVB</p>	<p>Een leverbare-valutaoptiesubklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 RTS23#13 en RTS23#47 — onderliggend valutapaar, gedefinieerd als combinatie van de twee onderliggende valuta's van het derivatencontract</p> <p>Segmenteringscriterium 2 RTS2#8 — looptijdsegment van de optie, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1 \text{ week}$</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ week} < \text{looptijd} \leq 3 \text{ maanden}$</p> <p>Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1 \text{ jaar}$</p> <p>Looptijdsegment 4: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2 \text{ jaar}$</p> <p>Looptijdsegment 5: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3 \text{ jaar}$</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n \text{ jaar}$</p>	<p>Voor leverbare valutaopties (DO's) wordt geacht geen liquide markt te bestaan</p>	

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria	
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
<p>Niet-leverbare valutaswaps (NDS)</p> <p>een swap die, zoals vastgelegd in de voorwaarden ervan, in contanten wordt afgewikkeld tussen de tegenpartijen, waarbij het afwikkelingsbedrag wordt bepaald door het verschil in de wisselkoers van twee valuta's tussen de transactiedatum en de waarderingsdatum. Op de afwikkelingsdatum zal de ene partij de andere partij het nettoverschil tussen i) de wisselkoers op de transactiedatum en ii) de wisselkoers op de waarderingsdatum verschuldigd zijn, op basis van de notionele waarde, welk nettobedrag wordt betaald in de in het contract vastgelegde afwikkelingsvaluta.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = SWAP</p> <p>RTS2#26 = NDLV</p>	<p>Een niet-leverbare-valutaswapsubklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 RTS23#13 en RTS23#47 — onderliggend valutapaar, gedefinieerd als combinatie van de twee onderliggende valuta's van het derivatencontract</p> <p>Segmenteringscriterium 2 RTS2#8 — looptijdsegment van de swap, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1 \text{ week}$</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ week} < \text{looptijd} \leq 3 \text{ maanden}$</p> <p>Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1 \text{ jaar}$</p> <p>Looptijdsegment 4: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2 \text{ jaar}$</p> <p>Looptijdsegment 5: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3 \text{ jaar}$</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n \text{ jaar}$</p>	<p>Voor niet-leverbare valutaswaps (NDS's) wordt geacht geen liquide markt te bestaan</p>	

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria	
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
<p>Leverbare valutaswaps (DS)</p> <p>een swap die uitsluitend de uitwisseling van twee verschillende valuta's op een specifieke, in het contract vastgelegde toekomstige afwikkelingsdatum omvat, tegen een vaste koers zoals overeengekomen bij het sluiten van het uitwisselingscontract.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = SWAP</p> <p>RTS2#26 = DLVB</p>	<p>een leverbare-valutaswapsubklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 RTS23#13 en RTS23#47 — onderliggend valutapaar, gedefinieerd als combinatie van de twee onderliggende valuta's van het derivatencontract</p> <p>Segmenteringscriterium 2 RTS2#8 — looptijdsegment van de swap, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1 \text{ week}$</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ week} < \text{looptijd} \leq 3 \text{ maanden}$</p> <p>Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1 \text{ jaar}$</p> <p>Looptijdsegment 4: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2 \text{ jaar}$</p> <p>Looptijdsegment 5: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3 \text{ jaar}$</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n \text{ jaar}$</p>	<p>voor leverbare valutaswaps (DS's) wordt geacht geen liquide markt te bestaan</p>	

Activaklasse — Valutaderivaten			
Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria	
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
Valutafutures RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FUTR	Een valutafuturesubklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria: Segmenteringscriterium 1 RTS23#13 en RTS23#47 — onderliggend valutapaar, gedefinieerd als combinatie van de twee onderliggende valuta's van het derivatencontract Segmenteringscriterium 2 RTS2#8 — looptijdsegment van de future, gedefinieerd als volgt: Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1 \text{ week}$ Looptijdsegment 2: $1 \text{ week} < \text{looptijd} \leq 3 \text{ maanden}$ Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1 \text{ jaar}$ Looptijdsegment 4: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2 \text{ jaar}$ Looptijdsegment 5: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3 \text{ jaar}$... Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n \text{ jaar}$	Voor valutafutures wordt geacht geen liquide markt te bestaan	
Activaklasse — Valutaderivaten			
Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt de volgende methodologie toegepast		
Overige valutaderivaten een valutaderivaat dat niet tot een van bovengenoemde subactivaklassen behoort RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = OTHR	Voor alle overige valutaderivaten wordt geacht geen liquide markt te bestaan".		

10) De tabellen 9.1, 9.2 en 9.3 worden vervangen door:

“Tabel 9.1

Kredietderivaten — klassen waarvoor geen liquide markt bestaat

Activaklasse — Kredietderivaten				
Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	On-the-run-status van de index [Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium]
<p>Indexkredietverzuimswap (CDS) een swap waarvan de uitwisseling van kasstromen is gekoppeld aan de kredietwaardigheid van verscheidene emittenten van financiële instrumenten die een index vormen, en aan het plaatsvinden van kredietgebeurtenissen</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT</p>	<p>een indexkredietverzuimswap-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 RTS2#34 — onderliggende index</p> <p>Segmenteringscriterium 2 RTS2#42 — notionele valuta, gedefinieerd als de valuta waarin de notionele waarde van het derivaat is uitgedrukt</p> <p>Segmenteringscriterium 3 RTS2#8 — looptijdsegment van de CDS, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 3: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3$ jaar</p> <p>...</p> <p>Looptijdsegment m: $(n-1) \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq n$ jaar</p>	200 000 000 EUR	10	<p>Voor de onderliggende index wordt geacht een liquide markt te bestaan:</p> <p>(1) gedurende de hele periode van zijn “on-the-run status”</p> <p>(2) gedurende de eerste 30 werkdagen van zijn “1x off-the-run status”</p> <p>Onder een “on-the-run”-index wordt verstaan: de voortschrijdende, meest recente versie (serie) van de index, gecreëerd op de datum waarop de samenstelling van de index van kracht is en eindigend een dag vóór de datum waarop de samenstelling van de volgende versie (serie) van de index van kracht wordt.</p> <p>Onder “1x off-the-run-status” wordt verstaan: de versie (serie) van de index die onmiddellijk voorafgaat aan de actuele “on-the-run”-versie (serie) op een zeker punt in de tijd. Een versie (serie) houdt op “on-the-run” te zijn en krijgt de “1x off-the-run-status” wanneer de meest recente versie (serie) van de index wordt gecreëerd.</p>

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	On-the-run-status van de index [Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium]
<p>Single-namekredietverzuimswap (CDS) een swap waarvan de uitwisseling van kasstromen is gekoppeld aan de kredietwaardigheid van één emittent van financiële instrumenten en aan het plaatsvinden van kredietgebeurtenissen</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT</p>	<p>een single-namekredietverzuimswap-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 RTS2#41 — onderliggende referentie-entiteit</p> <p>Segmenteringscriterium 2 RTS2#39 — onderliggend referentie-entiteitstype, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Onder “emittent van het type overheids- of publieke entiteit” wordt verstaan: een uitgevende entiteit die een van de volgende is:</p> <ul style="list-style-type: none"> (a) de Unie; (b) een lidstaat, met inbegrip van een regeringsdepartement, een agentschap of een special purpose vehicle van de lidstaat; (c) een niet onder a) en b) vallende overheidsentiteit; (d) in het geval van een lidstaat die een federale staat is, een lid van de federatie; (e) een special purpose vehicle voor verscheidene lidstaten; 	10 000 000 EUR	10	

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	On-the-run-status van de index [Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium]
	<p>(f) een door twee of meer lidstaten opgerichte internationale financiële instelling die tot doel heeft middelen bijeen te brengen en financiële bijstand te verlenen ten behoeve van haar leden als deze ernstige financiële problemen ondervinden of dreigen te ondervinden;</p> <p>(g) de Europese Investeringsbank;</p> <p>(h) een publieke entiteit die geen emittent van een overheidsobligatie als gespecificeerd onder a) tot en met c) is.</p> <p>Onder “emittent van het type onderneming” wordt verstaan: een uitgevende entiteit die geen emittent van het type overheids- of publieke entiteit is.</p> <p>Segmenteringscriterium 3 RTS2#42 — notionele valuta, gedefinieerd als de valuta waarin de notionele waarde van het derivaat is uitgedrukt</p> <p>Segmenteringscriterium 4 RTS2#8 — looptijdsegment van de CDS, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2$ jaar</p> <p>Looptijdsegment 3: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3$ jaar</p>			

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	On-the-run-status van de index [Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium]
	... Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar			
Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, onder b), wanneer de subklasse niet voldoet aan het volgende kwalitatieve liquiditeitscriterium		
<p>CDS-indexopties een optie waarvan het onderliggende een CDS-index is</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT</p>	<p>een CDS-indexoptie-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 RTS23#26 — CDS-indexsubklasse als gespecificeerd voor de subactivaklasse van indexkredietverzuimswaps (CDS's)</p> <p>Segmenteringscriterium 2 RTS2#8 — looptijdsegment van de optie, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 6 maanden</p> <p>Looptijdsegment 2: 6 maanden < looptijd ≤ 1 jaar</p> <p>Looptijdsegment 3: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar</p> <p>Looptijdsegment 4: 2 jaar < looptijd ≤ 3 jaar</p>	<p>Voor een CDS-indexoptie waarvan de onderliggende CDS-index een subklasse is waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan en waarvan het looptijdsegment 0-6 maanden is, wordt geacht een liquide markt te bestaan</p> <p>Voor een CDS-indexoptie waarvan de onderliggende CDS-index een subklasse is waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan en waarvan het looptijdsegment niet 0-6 maanden is, wordt niet geacht een liquide markt te bestaan</p> <p>Voor een CDS-indexoptie waarvan de onderliggende CDS-index een subklasse is waarvoor wordt geacht geen liquide markt te bestaan, wordt niet geacht een liquide markt te bestaan voor elk gegeven looptijdsegment</p>		

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	On-the-run-status van de index [Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium]
	... Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar			
<p>Single name-CDS-opties een optie waarvan het onderliggende een single name-CDS is</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT</p>	<p>Een single name-CDS-subklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria:</p> <p>Segmenteringscriterium 1 RTS23#26 — single name-CDS-subklasse als gespecificeerd voor de subactivaklasse van single name-CDS's</p> <p>Segmenteringscriterium 2 RTS2#8 — looptijdsegment van de optie, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: 0 < looptijd ≤ 6 maanden</p> <p>Looptijdsegment 2: 6 maanden < looptijd ≤ 1 jaar</p> <p>Looptijdsegment 3: 1 jaar < looptijd ≤ 2 jaar</p> <p>Looptijdsegment 4: 2 jaar < looptijd ≤ 3 jaar</p>	<p>Voor een single name-CDS-optie waarvan de onderliggende CDS een subklasse is waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan en waarvan het looptijdsegment 0-6 maanden is, wordt geacht een liquide markt te bestaan</p> <p>Voor een single name-CDS-optie waarvan de onderliggende CDS een subklasse is waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan en waarvan het looptijdsegment niet 0-6 maanden is, wordt niet geacht een liquide markt te bestaan</p> <p>Voor een single name-CDS-optie waarvan de onderliggende CDS een subklasse is waarvoor wordt geacht geen liquide markt te bestaan, wordt niet geacht een liquide markt te bestaan voor elk gegeven looptijdsegment</p>		

Activaklasse — Kredietderivaten				
Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria. Op subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan, wordt, indien van toepassing, het aanvullende kwalitatieve liquiditeitscriterium toegepast		
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]	On-the-run-status van de index [Aanvullend kwalitatief liquiditeitscriterium]
	...			
	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar			
Activaklasse — Kredietderivaten				
Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt de volgende methodologie toegepast			
Overige kredietderivaten een kredietderivaat dat niet tot een van bovengenoemde subactivaklassen behoort RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CRDT RTS2#5 = OTHR	Voor alle overige kredietderivaten wordt geacht geen liquide markt te bestaan			

Tabel 9.2

Kredietderivaten – SSTI- en LIS-drempels vóór en na de handel voor subklassen waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan

Activaklasse — Kredietderivaten														
Subactivaklasse	Toe te passen percentielen en ondergrenzen voor de berekening van de SSTI- en LIS-drempels vóór en na de handel voor elke subklasse waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan													
	In aanmerking te nemen transacties voor de berekening van de drempels	SSTI vóór de handel				LIS vóór de handel		SSTI na de handel			LIS na de handel			
		Transactie — percentiel				Ondergrens	Transactie — percentiel	Ondergrens	Transactie — percentiel	Volume — percentiel	Ondergrens	Transactie — percentiel	Volume — percentiel	Ondergrens
Indexkredietverzuimswap (CDS)	De berekening van drempels moet worden uitgevoerd voor elke subklasse van de subactivaklasse, waarbij alle transacties die worden uitgevoerd in financiële instrumenten die tot de subklasse behoren, in aanmerking moeten worden genomen	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									
Single-name-kredietverzuimswap (CDS)	De berekening van drempels moet worden uitgevoerd voor elke subklasse van de subactivaklasse, waarbij alle transacties die worden uitgevoerd in financiële instrumenten die tot de subklasse behoren, in aanmerking moeten worden genomen	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									

Activaklasse — Kredietderivaten														
Subactivaklasse	Toe te passen percentielen en ondergrenzen voor de berekening van de SSTI- en LIS-drempels vóór en na de handel voor elke subklasse waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan													
	In aanmerking te nemen transacties voor de berekening van de drempels	SSTI vóór de handel				LIS vóór de handel		SSTI na de handel			LIS na de handel			
		Transactie — percentiel				Ondergrens	Transactie — percentiel	Ondergrens	Transactie — percentiel	Volume — percentiel	Ondergrens	Transactie — percentiel	Volume — percentiel	Ondergrens
CDS-index-opties	De berekening van drempels moet worden uitgevoerd voor elke subklasse van de subactivaklasse, waarbij alle transacties die worden uitgevoerd in financiële instrumenten die tot de subklasse behoren, in aanmerking moeten worden genomen	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									
Single name-CDS-opties	De berekening van drempels moet worden uitgevoerd voor elke subklasse van de subactivaklasse, waarbij alle transacties die worden uitgevoerd in financiële instrumenten die tot de subklasse behoren, in aanmerking moeten worden genomen	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									

Tabel 9.3

Kredietderivaten — SSTI- en LIS-drempels vóór en na de handel voor subklassen waarvoor wordt geacht geen liquide markt te bestaan

Activaklasse — Kredietderivaten				
Subactivaklasse	SSTI- en LIS-drempels vóór en na de handel voor elke subklasse waarvoor wordt geacht geen liquide markt te bestaan			
	SSTI vóór de handel	LIS vóór de handel	SSTI na de handel	LIS na de handel
	Drempelwaarde	Drempelwaarde	Drempelwaarde	Drempelwaarde
Indexkredietverzuimswap (CDS)	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Single-namekredietverzuimswap (CDS)	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
CDS-indexopties	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Single name-CDS-opties	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR
Overige kredietderivaten	2 500 000 EUR	5 000 000 EUR	7 500 000 EUR	10 000 000 EUR”.

11) Tabel 10.1 wordt vervangen door:

“Tabel 10.1

C10-derivaten - klassen waarvoor geen liquide markt bestaat

Activaklasse — C10-derivaten			
Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria.	
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
Vrachtderivaten een financieel instrument dat verband houdt met vrachttarieven als omschreven in deel C, punt 10), van bijlage I bij Richtlijn 2014/65/EU RTS2#3 = “DERV” en RTS2#4 = “COMM” en RTS23#35 = “FRGT”	een vrachtderivaatsubklasse wordt gedefinieerd door de volgende segmenteringscriteria: Segmenteringscriterium 1 (RTS2#5) — contracttype: futures of opties Segmenteringscriterium 2 (RTS23#36) — vrachttype	10 000 000 EUR	10

Activaklasse — C10-derivaten			
Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria.	
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
	<p>Segmenteringscriterium 3 (RTS2#37) — vrachsub-type</p> <p>Segmenteringscriterium 4 (RTS2#12) — specificatie van de aan het vrachsubtype gerelateerde omvang</p> <p>Segmenteringscriterium 5 (RTS2#13) — specifieke route of gemiddelde tijdbevrachting</p> <p>Segmenteringscriterium 6 (RTS2#8) — looptijdsegment van het derivaat, gedefinieerd als volgt:</p> <p>Looptijdsegment 1: $0 < \text{looptijd} \leq 1 \text{ maand}$</p> <p>Looptijdsegment 2: $1 \text{ maand} < \text{looptijd} \leq 3 \text{ maanden}$</p> <p>Looptijdsegment 3: $3 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 6 \text{ maanden}$</p> <p>Looptijdsegment 4: $6 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 9 \text{ maanden}$</p> <p>Looptijdsegment 5: $9 \text{ maanden} < \text{looptijd} \leq 1 \text{ jaar}$</p> <p>Looptijdsegment 6: $1 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 2 \text{ jaar}$</p> <p>Looptijdsegment 7: $2 \text{ jaar} < \text{looptijd} \leq 3 \text{ jaar}$</p>		

Activaklasse — C10-derivaten			
Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria.	
		Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
	...		
	Looptijdsegment m: (n-1) jaar < looptijd ≤ n jaar		
Activaklasse — C10-derivaten			
Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt de volgende methodologie toegepast		
Overige C10-derivaten een financieel instrument als gedefinieerd in deel C, punt 10), van bijlage I bij Richtlijn 2014/65/EU dat geen “vrachtderivaat” is, elk van de volgende rentederivaten-subactivaklassen: “Inflation multi-currency swap of cross-currency swap”, een “future/forward op inflation multi-currency swaps of cross-currency swaps”, een “inflation single currency swap”, een “future/forward op inflation single currency swap” en een van de volgende subactivaklassen van aandelenderivaten: een “volatiliteitsindexoptie”, een “volatiliteitsindexfuture/-forward”, een swap met parameter return variance, een swap met parameter return volatility, een portefeuilleswap met parameter return variance, een portefeuilleswap met parameter return volatility	Voor alle overige C10-derivaten wordt geacht geen liquide markt te bestaan”.		

12) Tabel 11.1 wordt vervangen door:

“Tabel 11.1

CFD's - klassen waarvoor geen liquide markt bestaat

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Kwalitatief liquiditeitscriterium	Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
Valuta-CFD's RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = CURR	een valuta-CFD-subklasse wordt gedefinieerd door het onderliggende valutapaar als combinatie van de twee onderliggende valuta's van het CFD/spread betting-contract RTS2#30 en RTS2#31		50 000 000 EUR	100
Grondstoffen-CFD's RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = COMM	een grondstoffen-CFD-subklasse wordt gedefinieerd door de onderliggende grondstof van het CFD/spread betting-contract RTS23#35 en RTS23#36 en RTS23#37		50 000 000 EUR	100
Aandelen-CFD's RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = EQUI	een aandelen-CFD-subklasse wordt gedefinieerd door het onderliggende aandeel van het CFD/spread betting-contract RTS23#26	voor een aandelen-CFD-subklasse wordt geacht een liquide markt te bestaan wanneer het onderliggende een aandeleneffect is waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 2, lid 1, punt 17), b), van Verordening (EU) nr. 600/2014		
Obligatie-CFD's RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = BOND	een obligatie-CFD-subklasse wordt gedefinieerd door de onderliggende obligatie of obligatiefuture van het CFD/spread betting-contract RTS23#26	voor een obligatie-CFD-subklasse wordt geacht een liquide markt te bestaan wanneer het onderliggende een obligatie of obligatiefuture is waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1), punt b)		

Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt elke subactivaklasse verder gesegmenteerd in subklassen als hieronder omschreven	Kwalitatief liquiditeitscriterium	Gemiddelde dagelijkse notionele waarde (ADNA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
CFD's op een aandelenfuture/-forward RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = FTEQ	een subklasse van CFD's op een aandelenfuture/-forward wordt gedefinieerd door het onderliggende aandeel van het CFD/spread betting-contract RTS23#26	voor een subklasse van CFD's op een aandelenfuture/-forward wordt geacht een liquide markt te bestaan wanneer het onderliggende een aandelenfuture/-forward is waarvoor geacht wordt een liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1), punt b)		
CFD's op een aandelenoptie RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OPEQ	een CFD op een aandelenoptie-subklasse wordt gedefinieerd door de onderliggende optie op een aandeel van het CFD/spread betting-contract RTS23#26	voor een CFD op een aandelenoptie-subklasse wordt geacht een liquide markt te bestaan wanneer het onderliggende een aandelenoptie is waarvoor wordt geacht een liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1), punt b)		
Activaklasse – Financiële contracten ter verrekening van verschillen (“contracts for differences”, CFD's)				
Subactivaklasse	Om te bepalen voor welke klassen van financiële instrumenten wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wordt de volgende methodologie toegepast			
Overige CFD's				
een CFD/spread betting dat/die niet tot een van bovengenoemde subactivaklassen behoort RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OTHR	voor alle overige CFD/spread betting-derivaten wordt geacht geen liquide markt te bestaan”.			

13) Tabel 12.1 wordt vervangen door:

“Tabel 12.1

Emissierechten — klassen waarvoor geen liquide markt bestaat

Activaklasse — Emissierechten		
Subactivaklasse	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria.	
	Gemiddelde dagelijkse bedrag (ADA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
<p>Emissierechten van de Europese Unie (European Union Allowances, EUA)</p> <p>alle eenheden die erkend zijn voor naleving van de vereisten van Richtlijn 2003/87/EG van het Europees Parlement en de Raad ⁽¹⁾ (emissiehandelssysteem) en die het recht om het equivalent van één ton koolstofdioxide-equivalent (tCO₂e) uit te stoten vertegenwoordigen</p> <p>RTS2#3 = EMAL en RTS2#11 = EUAE</p>	150 000 ton koolstofdioxide-equivalent	5
<p>Luchtvaartemissierechten van de Europese Unie (EUAA)</p> <p>alle eenheden die erkend zijn voor naleving van de vereisten van Richtlijn 2003/87/EG (emissiehandelssysteem) en die het recht om het equivalent van één ton koolstofdioxide-equivalent (tCO₂e) uit te stoten door de luchtvaart vertegenwoordigen</p> <p>RTS2#3 = EMAL en RTS2#11 = EUAA</p>	150 000 ton koolstofdioxide-equivalent	5
<p>Gecertificeerde emissiereducties (Certified Emission Reductions, CER)</p> <p>alle eenheden die erkend zijn voor naleving van de vereisten van Richtlijn 2003/87/EG (emissiehandelssysteem) die het emissiereductie-equivalent van één ton koolstofdioxide-equivalent (tCO₂e) vertegenwoordigen</p> <p>RTS2#3 = EMAL en RTS2#11 = CERE</p>	150 000 ton koolstofdioxide-equivalent	5

Activaklasse — Emissierechten		
Subactivaklasse	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria.	
	Gemiddelde dagelijkse bedrag (ADA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
<p>Emissiereductie-eenheden (Emission Reduction Units, ERU)</p> <p>alle eenheden die erkend zijn voor naleving van de vereisten van Richtlijn 2003/87/EG (emissiehandelssysteem) die het emissiereductie-equivalent van één ton koolstofdioxide-equivalent (tCO₂e) vertegenwoordigen</p> <p>RTS2#3 = EMAL en RTS2#11 = ERUE</p>	150 000 ton koolstofdioxide-equivalent	5
<p>Overige emissierechten</p> <p>een emissierecht dat erkend is voor naleving van de vereisten van Richtlijn 2003/87/EG (regeling voor de handel in emissierechten) en dat niet valt onder emissierechten van de Europese Unie (EUA), luchtvaartemissierechten van de Europese Unie (EUAA), gecertificeerde emissiereducties (CER) en emissiereductie-eenheden (ERU)</p> <p>RTS2#3 = EMAL en RTS2#11 = OTHR</p>	voor alle overige emissierechten wordt geacht geen liquide markt te bestaan	
<p>(¹) Richtlijn 2003/87/EG van het Europees Parlement en de Raad van 13 oktober 2003 tot vaststelling van een regeling voor de handel in broeikasgasemissierechten binnen de Gemeenschap en tot wijziging van Richtlijn 96/61/EG van de Raad (PB L 275 van 25.10.2003, blz. 32)."</p>		

14) Tabel 13.1 wordt vervangen door:

“Tabel 13.1

Emissierechtderivaten — klassen waarvoor geen liquide markt bestaat

Subactivaklasse	Activaklasse — Emissierechtderivaten	
	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria	
	Gemiddelde dagelijkse bedrag (ADA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
<p>Emissierechtderivaten waarvan het onderliggende van het type emissierechten van de Europese Unie (EUA) is</p> <p>een financieel instrument dat verband houdt met emissierechten van het type emissierechten van de Europese Unie (EUA) als omschreven in deel C, punt 4), van bijlage I bij Richtlijn 2014/65/EU</p> <p>RTS2#3 = DERV en RTS2#4 = EMAL en RTS2#43 = EUAE</p>	150 000 ton koolstofdioxide-equivalent	5
<p>Emissierechtderivaten waarvan het onderliggende van het type luchtvaartemissierechten van de Europese Unie (EUAA) is</p> <p>een financieel instrument dat verband houdt met emissierechten van het type luchtvaartemissierechten van de Europese Unie (EUAA) als omschreven in deel C, punt 4), van bijlage I bij Richtlijn 2014/65/EU</p> <p>RTS2#3 = DERV en RTS2#4 = EMAL en RTS2#43 = EUAA</p>	150 000 ton koolstofdioxide-equivalent	5
<p>Emissierechtderivaten waarvan het onderliggende van het type gecertificeerde emissiereducties (CER) is</p> <p>een financieel instrument dat verband houdt met emissierechten van het type gecertificeerde emissiereducties (CER) als omschreven in deel C, punt 4), van bijlage I bij Richtlijn 2014/65/EU</p> <p>RTS2#3 = DERV en RTS2#4 = EMAL en RTS2#43 = CERE</p>	150 000 ton koolstofdioxide-equivalent	5

Activaklasse — Emissierechtderivaten		
Subactivaklasse	Voor elke subklasse wordt geacht geen liquide markt te bestaan overeenkomstig artikel 6 en artikel 8, lid 1, punt b), wanneer de subklasse niet voldoet aan een van de of alle volgende drempels van de kwantitatieve liquiditeitscriteria	
	Gemiddelde dagelijkse bedrag (ADA) [kwantitatief liquiditeitscriterium 1]	Gemiddeld aantal dagelijkse transacties [kwantitatief liquiditeitscriterium 2]
<p>Emissierechtderivaten waarvan het onderliggende van het type Emission Reduction Units (ERU) is</p> <p>een financieel instrument dat verband houdt met emissierechten van het type emissiereductie-eenheden (ERU) als omschreven in deel C, punt 4), van bijlage I bij Richtlijn 2014/65/EU</p> <p>RTS2#3 = DERV en RTS2#4 = EMAL en RTS2#43 = ERUE</p>	150 000 ton koolstofdioxide-equivalent	5
<p>Overige emissierechtderivaten</p> <p>een emissierechtderivaat waarvan het onderliggende een emissierecht is dat erkend is voor naleving van de vereisten van Richtlijn 2003/87/EG (regeling voor de handel in emissierechten) en dat niet valt onder emissierechten van de Europese Unie (EUA), luchtvaartemissierechten van de Europese Unie (EUAA), gecertificeerde emissiereducties (CER) en emissiereductie-eenheden (ERU)</p> <p>RTS2#3 = DERV en RTS2#4 = EMAL en RTS2#43 = OTHR</p>	voor alle overige emissierechtderivaten wordt geacht geen liquide markt te bestaan”.	

BIJLAGE IV

In bijlage IV worden de tabellen 1 en 2 vervangen door:

“Tabel 1

Tabel van symbolen voor tabel 2

SYMBOOL	TYPE GEGEVENS	DEFINITIE
{ALPHANUM-n}	Maximaal n alfanumerieke tekens	Veld voor vrije tekst.
{DECIMAL-n/m}	Decimaal getal van maximaal n cijfers in totaal, waarvan maximaal m cijfers fractiecijfers kunnen zijn.	Numeriek veld voor zowel positieve als negatieve waarden: — het decimaalteken is “.” (punt); — het getal kan worden voorafgegaan door “-” (minus) om negatieve getallen aan te duiden. Indien nodig worden waarden afgerond, niet afgebroken.
{COUNTRYCODE_2}	2 alfanumerieke tekens	2-letterige landcode overeenkomstig de ISO 3166-1-alfa-2-landcode
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumerieke tekens	3-letterige valutacode volgens ISO 4217 valutacodes.
{DATEFORMAT}	Datumformaat volgens ISO 8601	Data worden weergegeven in het volgende formaat: JJJJ-MM-DD.
{ISIN}	12 alfanumerieke tekens	ISIN-code volgens ISO 6166.
{LEI}	20 alfanumerieke tekens	Identificatiecode juridische entiteit volgens ISO 17442
{MIC}	4 alfanumerieke tekens	Marktidentificatiecode volgens ISO 10383
{EIC}	16 alfanumerieke tekens	een EIC-code met betrekking tot een leveringspunt binnen of buiten de Europese Unie
{INDEX}	4 letters	“EONA” — EONIA “EONS” — EONIA SWAP “EURI” — EURIBOR “EUUS” — EURODOLLAR “EUCH” — EuroSwiss “GCFR” — GCF REPO “ISDA” — ISDAFIX “LIBI” — LIBID “LIBO” — LIBOR

SYMBOOL	TYPE GEGEVENS	DEFINITIE
		"MAAA" — Muni AAA "PFAN" — Pandbrieven "TIBO" — TIBOR "STBO" — STIBOR "BBSW" — BBSW "JIBA" — JIBAR "BUBO" — BUBOR "CDOR" — CDOR "CIBO" — CIBOR

Tabel 2

Voor transparantieberekeningen te verstrekken details van de referentiegegevens

#	VELD	TE RAPPORTEREN GEGEVENS	RAPPORTAGEFORMAAT
1	Instrumentidentificatiecode	Voor het identificeren van het financieel instrument gebruikte code	{ISIN}
2	Volledige naam instrument	Volledige naam van het financieel instrument	{ALPHANUM-350}
3	MiFIR-identificatiecode	<p>Identificatie van andere financiële instrumenten dan eigenvermogensinstrumenten</p> <p>Gesecuritiseerde derivaten als omschreven in tabel 4.1 in deel 4 van bijlage III</p> <p>Gestructureerde financiële producten (GFP's) als omschreven in artikel 2, lid 1, punt 28), van Verordening (EU) nr. 600/2014</p> <p>Obligaties (voor alle obligaties met uitzondering van ETC's en ETN's) als omschreven in artikel 4, lid 1, punt 44, b), van Richtlijn 2014/65/EU</p> <p>ETC's als omschreven in artikel 4, lid 1, punt 44, b), van Richtlijn 2014/65/EU en nader gespecificeerd in tabel 2.4 van deel 2 van bijlage III</p> <p>ETN's als omschreven in artikel 4, lid 1, punt 44, b), van Richtlijn 2014/65/EU en nader gespecificeerd in tabel 2.4 van deel 2 van bijlage III</p>	<p>Andere financiële instrumenten dan eigenvermogensinstrumenten:</p> <p>"SDRV" — Gesecuritiseerde derivaten</p> <p>"SFPS" — Gestructureerde financiële producten (GFP's)</p> <p>"BOND" — Obligaties</p> <p>"ETCS" — ETC's</p> <p>"ETNS" — ETN's</p> <p>"EMAL" — Emissierechten</p> <p>"DERV" — Derivaat</p>

#	VELD	TE RAPPORTEREN GEGEVENS	RAPPORTAGEFORMAAT
		<p>Emissierechten als omschreven in tabel 12.1 in deel 12 van bijlage III</p> <p>Derivaten als omschreven in deel C, punten 4 tot met 10, van bijlage I bij Richtlijn 2014/65/EU</p>	
4	Activaklasse van het onderliggende	Invullen wanneer de MiFIR-identificatiecode betrekking heeft op een gesecuritiseerd derivaat of een derivaat.	<p>“INTR” — Rente</p> <p>“EQUI” — Aandeel</p> <p>“COMM” — Grondstof</p> <p>“CRDT” — Krediet</p> <p>“CURR” — Valuta</p> <p>“EMAL” — Emissierechten</p> <p>“OCTN” — Overige C10</p>
5	Type contract	Invullen wanneer de MiFIR-identificatiecode betrekking heeft op een derivaat.	<p>“OPTN” — Opties</p> <p>“FUTR” — futures (inclusief — toekomstgerichte vrachtovereenkomsten (FFA's))</p> <p>“FRAS” — Forwardrenteo-vereenkomst (Forward Rate Agreement)</p> <p>“FORW” — Forwards</p> <p>“SWAP” — Swaps</p> <p>“PSWP” — Portefeuilleswaps</p> <p>“SWPT” — Swaptions</p> <p>“OPTS” — Optie op een swap</p> <p>“FONS” — Futures op een swap</p> <p>“FWOS” — Forwards op een swap</p> <p>“SPDB” — Spread betting</p> <p>“CFDS” — CFD</p> <p>“OTHR” — Overig</p>
6	Rapportagedag	Dag waarvoor de referentiegegevens worden verstrekt	{DATEFORMAT}

#	VELD	TE RAPPORTEREN GEGEVENS	RAPPORTAGEFORMAAT
7	Handelsplatform	Segment-MIC voor het handelsplatform, voor zover beschikbaar, anders exploitant-MIC	{MIC}
8	Looptijd	Vastgestelde looptijd van het financiële instrument. Veld van toepassing op de activaklassen van obligaties, rentederivaten, aandelenderivaten, grondstofderivaten, valutaderivaten, kredietderivaten, C10-derivaten en emissierechtenderivaten.	{DATEFORMAT}

Velden voor obligaties (met uitzondering van ETC's en ETN's)

De velden in dit deel moeten alleen worden ingevuld voor obligaties als omschreven in tabel 2.1 van deel 2 van bijlage III

9	Obligatietype	Obligatietype als gespecificeerd in tabel 2.2 van deel 2 van bijlage III. Alleen invullen wanneer de MiFIR-identificatiecode betrekking heeft op een obligatie.	"EUSB" — Overheidsobligatie "OEPB" — Andere publieke obligatie "CVTB" — Converteerbare obligatie "CVDB" — Gedekte obligatie "CRPB" — Bedrijfsobligatie "OTHR" — Overig
10	Uitgiftedatum	Datum waarop een obligatie wordt uitgegeven en rente begint op te bouwen.	{DATEFORMAT}

Velden voor emissierechten

De velden in dit deel moeten alleen worden ingevuld voor emissierechten als omschreven in tabel 12.1 van deel 12 van bijlage III

11	Emissierechtensubtype	Emissierechten	"CERE" — CER "ERUE" — ERU "EUAE" — EUA "EUAA" — EUAA "OTHR" — Overig
----	-----------------------	----------------	--

Velden voor derivaten
Grondstoffenderivaten en C10-derivaten

De velden in dit deel moeten alleen worden ingevuld voor grondstoffenderivaten als omschreven in tabel 7.1 van deel 7 van bijlage III en voor C10-derivaten als omschreven in tabel 10.1 van deel 10 van bijlage III.

12	Specificatie van de aan het vrachsubtype gerelateerde omvang	Veld invullen wanneer het in veld 35 in tabel 2 van de bijlage bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/585 gespecificeerde basisproduct gelijk is aan vracht.	<p>Voor droge vracht:</p> <p>“CAPE” — Capesize</p> <p>“PNMX” — Panamax</p> <p>“SPMX” — Supramax</p> <p>“HAND” — Handysize</p> <p>Voor natte vracht:</p> <p>“CLAN” — Clean</p> <p>“DRTY” — Dirty</p> <p>{ALPHANUM-4} anders</p>
13	Specifieke route- of gemiddelde tijdbevrachtiging	Veld invullen wanneer het in veld 35 in tabel 2 van de bijlage bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/585 gespecificeerde basisproduct gelijk is aan vracht.	<p>Voor natte vracht:</p> <p>“TD7” — TD7</p> <p>“TD8” — TD8</p> <p>“TD17” — TD17</p> <p>“TD19” — TD19</p> <p>“TD20” — TD20</p> <p>“BLPG1” — BLPG1</p> <p>“TD3C” — TD3C</p> <p>“TC2” — TC2</p> <p>“TC2_37” — TC2_37</p> <p>“TD3” — TD3</p> <p>“TC5” — TC5</p> <p>“TC6” — TC6</p> <p>“TC7” — TC7</p> <p>“TC9” — TC9</p> <p>“TC12” — TC12</p> <p>“TC14” — TC14</p> <p>“TC15” — TC15</p>

			<p>Voor droge vracht:</p> <p>“4TC” — 4TC</p> <p>“5TC” — 5TC</p> <p>“6TC” — 6TC</p> <p>“10TC” — 10TC</p> <p>“C3” — C3</p> <p>“C5” — C5</p> <p>“C7” — C7</p> <p>“P1A” — P1A</p> <p>“P2A” — P2A</p> <p>“P3A” — P3A</p> <p>“P1E” — P1E</p> <p>“P2E” — P2E</p> <p>“P3E” — P3E</p> <p>{ALPHANUM-6} anders</p>
14	Locatie van de levering/afhandeling in contanten	Veld invullen wanneer het in veld 35 in tabel 2 van de bijlage bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2017/585 gespecificeerde basisproduct gelijk is aan energie.	<p>{EIC} voor elektriciteit of aardgas</p> <p>“OTHR” — Anders</p>
15	Notionele valuta	Valuta waarin de notionele waarde is uitgedrukt.	{CURRENCYCODE_3}

Rentederivaten

De velden in dit deel moeten alleen worden ingevuld voor rentederivaten als omschreven in tabel 5.1 van deel 5 van bijlage III

16	Type onderliggende waarde	<p>Invullen voor andere contracttypen dan swaps, swaptions, futures op een swap en forwards op een swap met een van de volgende alternatieven</p> <p>***** ****</p> <p>Invullen voor de contracttypen swaps, swaptions, futures op een swap en forwards op een swap met betrekking tot de onderliggende swap met een van de volgende alternatieven</p>	<p>“BOND” — Obligatie</p> <p>“BNDF” — Obligatiefutures</p> <p>“INTR” — Rente</p> <p>“IFUT” — Rentefutures/ FRA</p> <p>***** **</p> <p>“FFMC” — FLOAT TO FLOAT MULTI-CUR- RENCY SWAPS</p>
----	---------------------------	--	--

			<p>“XFMC” — FIXED TO FLOAT MULTI-CURRENCY SWAPS</p> <p>“XXMC” — FIXED TO FIXED MULTI-CURRENCY SWAPS</p> <p>“OSMC” — OIS MULTI-CURRENCY SWAPS</p> <p>“IFMC” — INFLATION MULTI-CURRENCY SWAPS</p> <p>“FFSC” — FLOAT TO FLOAT SINGLE-CURRENCY SWAPS</p> <p>“XFSC” — FIXED TO FLOAT SINGLE-CURRENCY SWAPS</p> <p>“XXSC” — FIXED TO FIXED SINGLE-CURRENCY SWAPS</p> <p>“OSSC” — OIS SINGLE-CURRENCY SWAPS</p> <p>“IFSC” — INFLATION SINGLE-CURRENCY SWAPS</p>
17	Emittent van de onderliggende obligatie	Veld invullen wanneer het onderliggende type een obligatie of een obligatiefuture is met de identificatiecode voor de rechtspersoon (LEI) van de emittent van de rechtstreeks of uiteindelijk onderliggende obligatie.	{LEI}
18	Vervaldatum van de onderliggende obligatie	Veld invullen met de vervaldatum van de onderliggende obligatie	{DATEFORMAT}
19	Datum van uitgifte van de onderliggende obligatie	Veld invullen met de datum van uitgifte van de onderliggende obligatie	{DATEFORMAT}
20	Notionele valuta van de swaption	Alleen invullen voor swaptions	{CURRENCYCODE_3}
21	Looptijd van de onderliggende swap	Alleen invullen voor swaptions, opties op swaps, futures op swaps en forwards op een swap.	{DATEFORMAT}

22	ISIN-code van de inflatie-index / ISIN-code van de onderliggende obligatie	<p>In geval van swaptions op een van de volgende onderliggende swaptypen: inflation single currency swap, futures/forwards op inflation single currency swap, inflation multi-currency swap, futures/forwards op inflation multi-currency swap; wanneer de inflatie-index een ISIN heeft, moet het veld worden ingevuld met de ISIN-code voor die index.</p> <p>***** ***</p> <p>In geval van obligatieopties/ opties op een obligatie-optie/ opties op een obligatiefuture moet in het veld de ISIN-code van de uiteindelijke onderliggende obligatie worden ingevuld.</p>	<p>{ISIN}</p> <p>*****</p> <p>{ISIN}</p>
23	Naam inflatie-index	Invullen met de gestandaardiseerde naam van de index in geval van swaptions op een van de volgende onderliggende swaptypen: inflation single currency swap, futures/forwards op inflation single currency swap, inflation multi-currency swap, futures/forwards op inflation multi-currency swap.	{ALPHANUM-25}
24	Referentiepercentage	Naam van het referentiepercentage.	<p>{INDEX}</p> <p>of</p> <p>{ALPHANUM-25} — indien het referentiepercentage niet is opgenomen op de INDEX-lijst</p>
25	Termijn van de onderliggende rente	<p>In dit veld wordt de termijn van de aan het contract ten grondslag liggende rente ingevuld. De termijn wordt uitgedrukt in dagen, weken, maanden of jaren.</p> <p>Te beginnen met de grootste eenheid van de termijn (jaren) en daarna in aflopende volgorde; als de rentetermijn een geheel getal is, moet een dergelijke standaardterm in dit veld worden ingevuld.</p>	<p>{INTEGER-3}+“DAYS” — dagen</p> <p>{INTEGER-3}+“WEEK” — weken</p> <p>{INTEGER-3}+“MNTH” — maanden</p> <p>{INTEGER-3}+“YEAR” — jaren</p>

Valutaderivaten

De velden in dit deel moeten alleen worden ingevuld voor valutaderivaten als omschreven in tabel 8.1 van deel 8 van bijlage III

26	Contractsubtype	In te vullen om onderscheid te maken tussen leverbare en niet-leverbare forwards, opties en swaps als omschreven in tabel 8.1 van deel 8 van bijlage III.	“DLVR” — Leverbaar “NDLV” — Niet leverbaar
----	-----------------	---	---

Aandelenderivaten

De velden moeten alleen worden ingevuld voor aandelenderivaten als omschreven in tabel 6.1 van deel 6 van bijlage III

27	Type onderliggende waarde	<p>Invullen wanneer de MiFIR-identificatiecode betrekking heeft op een derivaat, de activaklasse van het onderliggende aandelen is en de subactivaklasse niet swaps of portefeuilleswaps is.</p> <p>*****</p> <p>Invullen wanneer de MiFIR-identificatiecode betrekking heeft op een derivaat, de activaklasse van het onderliggende aandelen is, de subactivaklasse ofwel swaps, ofwel portefeuilleswaps is en het segmenteringscriterium 2 als omschreven in tabel 6.1 van deel 6 van bijlage III een single name is.</p>	<p>“STIX” — Aandelenindex</p> <p>“SHRS” — Aandeel</p> <p>“DIVI” — Dividendindex</p> <p>“DVSE” — Aandelendividend</p> <p>“BSKT” — Mandje van aandelen resulterend uit een bedrijfsmaatregel</p> <p>“ETFS” — ETF's</p> <p>“VOLI” — Volatiliteitsindex</p> <p>“OTHR” — Overig (met inbegrip van representatieve certificaten (depository receipts), certificaten en andere aandeelachtige financiële instrumenten)</p> <p>*****</p> <p>“SHRS” — Aandeel</p> <p>“DVSE” — Aandelendividend</p> <p>“ETFS” — ETF's</p> <p>“OTHR” — Overig (met inbegrip van representatieve certificaten (depository receipts), certificaten en andere aandeelachtige financiële instrumenten)</p>
----	---------------------------	---	---

		<p>*****</p> <p>Invullen wanneer de MiFIR-identificatiecode betrekking heeft op een derivaat, de activaklasse van het onderliggende aandelen is, de subactivaklasse ofwel swaps, ofwel portefeuilleswaps is en het segmenteringscriterium 2 als omschreven in tabel 6.1 van deel 6 van bijlage III een index is.</p> <p>*****</p> <p>Invullen wanneer de MiFIR-identificatiecode betrekking heeft op een derivaat, de activaklasse van het onderliggende aandelen is, de subactivaklasse ofwel swaps, ofwel portefeuilleswaps is en het segmenteringscriterium 2 als omschreven in tabel 6.1 van deel 6 van bijlage III een mandje is.</p>	<p>*****</p> <p>“STIX” — Aandelenindex</p> <p>“DIVI” — Dividendindex</p> <p>“VOLI” — Volatiliteitsindex</p> <p>“OTHR” — Overig</p> <p>*****</p> <p>“BSKT” — Mandje</p>
28	Parameter	<p>Invullen wanneer de MiFIR-identificatiecode betrekking heeft op een derivaat, de activaklasse van het onderliggende aandelen is en de subactivaklasse een van de volgende is: swaps, portefeuilleswaps.</p>	<p>“PRBP” — Price return basic performance parameter</p> <p>“PRDV” — Parameter return dividend</p> <p>“PRVA” — Parameter return variance</p> <p>“PRVO” — Parameter return volatility</p>

Contracts for difference (CFD's)

De velden moeten alleen worden ingevuld wanneer het contracttype gelijk is aan contract for difference of spread betting

29	Type onderliggende waarde	<p>Invullen wanneer de MiFIR-identificatiecode een derivaat is en het contracttype gelijk is aan contract for difference of spread betting</p>	<p>“CURR” — Valuta</p> <p>“EQUI” — Aandeel</p> <p>“BOND” — Obligaties</p> <p>“FTEQ” — Futures op een aandeel</p> <p>“OPEQ” — Opties op een aandeel</p> <p>“COMM” — Grondstof</p> <p>“EMAL” — Emissierechten</p> <p>“OTHR” — Overig</p>
----	---------------------------	--	--

30	Notionele valuta 1	Valuta 1 van het onderliggende valutapaar. Dit veld is van toepassing wanneer het onderliggende type valuta is	{CURRENCYCODE_3}
31	Notionele valuta 2	Valuta 2 van het onderliggende valutapaar. Dit veld is van toepassing wanneer het onderliggende type valuta is	{CURRENCYCODE_3}

Kredietderivaten

De velden in dit deel moeten alleen worden ingevuld voor kredietderivaten als omschreven in tabel 9.1 van deel 9 van bijlage III

32	ISIN-code van de onderliggende kredietverzuimswap	Invullen voor derivaten op kredietverzuimswaps met de ISIN-code van de onderliggende swap.	{ISIN}
33	Code onderliggende index	Invullen voor derivaten op een CDS-index met de ISIN-code van de index.	{ISIN}
34	Naam onderliggende index	Invullen voor derivaten op een CDS-index met de gestandaardiseerde naam van de index.	{ALPHANUM-25}
35	Serie	Het serienummer van de samenstelling van de index indien van toepassing. Invullen voor een CDS-index of een derivaat op een CDS-index met het serienummer van de CDS-index.	{DECIMAL-18/17}
36	Versie	Een nieuwe versie van een serie wordt uitgegeven wanneer een van de bestanddelen in gebreke blijft en de index opnieuw moet worden gewogen om het nieuwe aantal totale bestanddelen binnen de index in aanmerking te nemen. Invullen voor een CDS-index of een derivaat op een CDS-index met de versie van de CDS-index.	{DECIMAL-18/17}
37	Roll-maanden	Alle maanden wanneer de voortschrijding (roll) wordt verwacht als vastgesteld door de indexaanbieder voor een gegeven jaar. Moet worden herhaald voor elke roll-maand Invullen voor een CDS-index of een derivaat op een CDS-index.	"01", "02", "03", "04", "05", "06", "07", "08", "09", "10", "11", "12"
38	Volgende roll-datum	Invullen voor een CDS-index of een derivaat op een CDS-index met de volgende roll-datum van de index als vastgesteld door de indexaanbieder.	{DATEFORMAT}

39	Emittent van het type overheids- of publieke entiteit	Invullen wanneer de referentie-entiteit van een single name-CDS of een derivaat op een single name-CDS een overheidsemissent is als omschreven in tabel 9.1 van deel 9 van bijlage III.	“TRUE” — de referentie-entiteit is een emittent van het type overheids- of publieke entiteit “FALSE” — de referentie-entiteit is geen emittent van het type overheids- of publieke entiteit
40	Referentieverplichting	Invullen voor derivaten op een single name-kredietverzuimswap met de ISIN-code van de referentieverplichting.	{ISIN}
41	Referentie-entiteit	Invullen met de referentie-entiteit van een single name-CDS of een derivaat op een single name-CDS.	{COUNTRYCODE_2} of ISO 3166-2 — 2-letterige landencode gevolgd door een streepje “-” en code voor de onderverdeling van een land van maximaal 3 alfanumerieke karakters of {LEI}
42	Notionele valuta	Valuta waarin de notionele waarde is uitgedrukt.	{CURRENCYCODE_3}

Emissierechtderivaten

De velden in dit deel moeten alleen worden ingevuld voor emissierechtderivaten als omschreven in tabel 13.1 van deel 13 van bijlage III

43	Subtype emissierechtderivaten	Invullen wanneer variabele #3 “MiFIR-identificatiecode” “DERV”-derivaat is en variabele #4 “activaklasse van het onderliggende” “EMAL”-emissierechten is.	“CERE” — CER “ERUE” — ERU “EUAE” — EUA “EUAA” — EUAA “OTHR” — Overig”.
----	-------------------------------	---	--

BIJLAGE V

"BIJLAGE V

Voor transparantieberekeningen te verstrekken kwantitatieve gegevens

Tabel 1

Tabel van symbolen voor tabel 2

Symbool	Type gegevens	Definitie
{ALPHANUM-n}	Maximaal n alfanumerieke tekens	Veld voor vrije tekst.
{ISIN}	12 alfanumerieke tekens	ISIN-code volgens ISO 6166.
{MIC}	4 alfanumerieke tekens	Marktidentificatiecode volgens ISO 10383
{DATEFORMAT}	Datumformaat volgens ISO 8601	Data worden weergegeven in het volgende formaat: JJJJ-MM-DD.
{DECIMAL-n/m}	Decimaal getal van maximaal n cijfers in totaal, waarvan maximaal m cijfers fractiecijfers kunnen zijn.	Numeriek veld voor zowel positieve als negatieve waarden: Het decimaalteken is "." (punt); negatieve getallen worden voorafgegaan door "-" (minus); waarden worden afgerond, niet afgebroken.
{INTEGER-n}	Geheel getal van maximaal n cijfers	Numeriek veld voor zowel positieve als negatieve gehele waarden.

Tabel 2

Details van de gegevens die moeten worden verstrekt voor het bepalen van een liquide markt, de LIS- en SSTI-drempels voor andere financiële instrumenten dan eigenvermogensinstrumenten

#	Veld	Te rapporteren gegevens	Type uitvoering of publicatieplatform	Formaat en normen voor melding
1	Instrumentidentificatiecode	Voor het identificeren van het financieel instrument gebruikte code	Gereguleerde markt (RM) Multilaterale handelsfaciliteit (MTF) Georganiseerde handelsfaciliteit (OTF) Goedgekeurde publicatieregeling (APA) Verstrekker van consolidated tape (CTP)	{ISIN}

#	Veld	Te rapporteren gegevens	Type uitvoering of publicatieplatform	Formaat en normen voor melding
2	Datum van uitvoering	Datum waarop de transacties worden uitgevoerd.	RM, MTF, OTF APA, CTP	{DATEFORMAT}
3	Plaats van uitvoering	Segment-MIC van het handelsplatform of de beleggingsonderneming met systematische interne afhandeling uit de EU, voor zover beschikbaar, anders exploitant-MIC. Segment-MIC van de beleggingsonderneming met systematische interne afhandeling, voor zover beschikbaar, anders exploitant-MIC. De MIC-code XOFF voor otc-transacties. Voor een bepaalde ISIN en uitvoeringsdatum moeten APA's alle otc-handelsactiviteit voor dat instrument in één record vermelden (ISIN, XOFF, uitvoeringsdatum).	RM, MTF, OTF APA, CTP	{MIC} van het handelsplatform of de beleggingsonderneming met systematische interne afhandeling of "XOFF"
4	Markering van opgeschorte instrumenten	Indicator of de handel in het instrument op de uitvoeringsdatum gedurende de hele dag was opgeschort op het desbetreffende handelsplatform. Indien dit het geval is, wordt in veld 5 een waarde van nul gerapporteerd.	RM, MTF, OTF	"TRUE" – indien de handel in het instrument gedurende de hele handelsdag was opgeschort of "FALSE" – indien de handel in het instrument niet gedurende de hele handelsdag was opgeschort
5	Totaal aantal transacties	Het totale aantal op de uitvoeringsdatum uitgevoerde transacties. Geannuleerde transacties moeten van de gerapporteerde cijfers worden uitgesloten. Transacties waarvoor uitgestelde openbaarmaking geldt, worden meegeteld in de aggregaten die door de indienende entiteiten worden verstrekt op basis van de uitvoeringsdatum. In alle gevallen moet het veld worden ingevuld met een waarde groter dan of gelijk aan nul. Voor instrumenten waarvoor de handel de hele dag is opgeschort, moet het veld een nulwaarde hebben.	RM, MTF, OTF APA, CTP	{INTEGER-18}
6	Totaal volume	Het totale op de uitvoeringsdatum uitgevoerde volume. Het volume wordt gemeten overeenkomstig tabel 4 van bijlage II bij deze verordening. Geldbedragen worden gerapporteerd in euro. Geannuleerde transacties moeten van de gerapporteerde cijfers worden uitgesloten. Transacties waarvoor uitgestelde openbaarmaking geldt, worden meegeteld in de aggregaten die door de indienende entiteiten worden verstrekt op basis van de uitvoeringsdatum.	RM, MTF, OTF APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

#	Veld	Te rapporteren gegevens	Type uitvoering of publicatieplatform	Formaat en normen voor melding
7	Bereik van het transactieomvangsegment	<p>In dit veld worden de in de tabellen 3 en 4 van deze bijlage verstrekte waarden ingevuld.</p> <p>Het bereik van het transactieomvangsegment zoals gedefinieerd:</p> <p>in tabel 4 van deze bijlage voor emissierechten en derivaten daarvan;</p> <p>In tabel 3 van deze bijlage voor de andere instrumenten.</p> <p>Voor instrumenten waarvoor de handel de hele dag is opgeschort, worden de gegevens met betrekking tot dit veld en de velden 8 en 9 niet gerapporteerd.</p>	RM, MTF, OTF APA, CTP	{ALFANUM - -140}
8	Totaal aantal voor dat segment uitgevoerde transacties	<p>Totaal aantal op de datum van uitvoering uitgevoerde transacties waarvan de omvang binnen het bereik van het segment ligt.</p> <p>Geannuleerde transacties moeten van de gerapporteerde cijfers worden uitgesloten.</p> <p>Transacties waarvoor uitgestelde openbaarmaking geldt, worden meegeteld in de aggregaten die door de indienende entiteiten worden verstrekt op basis van de uitvoeringsdatum.</p>	RM, MTF, OTF APA, CTP	{INTEGER-18}
9	Totaal verhandelde volume voor dat segment	<p>Totaal verhandelde volume van alle op de rapportagedag uitgevoerde transacties waarvan de omvang binnen het bereik van het segment ligt.</p> <p>Het volume wordt gemeten overeenkomstig tabel 4 van bijlage II bij deze verordening.</p> <p>Geldbedragen worden gerapporteerd in euro's.</p> <p>Geannuleerde transacties moeten van de gerapporteerde cijfers worden uitgesloten.</p> <p>Transacties waarvoor uitgestelde openbaarmaking geldt, worden meegeteld in de aggregaten die door de indienende entiteiten worden verstrekt op basis van de uitvoeringsdatum.</p>	RM, MTF, OTF APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

Tabel 3

Transactieomvangsegmenten voor obligaties, SFP's, gesecuritiseerde derivaten, rentederivaten, aandelenderivaten, valutaderivaten, kredietderivaten, grondstoffenderivaten, C10-derivaten en CFD's

Omvang	Transactieomvangsegment	Definitie
Transacties met een omvang tussen 0 en 1,000,000 (niet inbegrepen)]0 – 100,000[Transacties met een omvang kleiner dan 100,000 EUR
]100,000 – 100,000[Transacties met een omvang gelijk aan 100,000 EUR
]100,000 – 200,000[Transacties met een omvang groter dan 100,000 EUR en kleiner dan 200,000 EUR
	[200,000 – 300,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 200,000 EUR en kleiner dan 300,000 EUR
	[300,000 – 400,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 300,000 EUR en kleiner dan 400,000 EUR
	[Y– Y+ 100,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan Y EUR en kleiner dan Y + 100,000 EUR (stap 100,000 EUR)
	[900,000 – 1,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 900,000 EUR en kleiner dan 1,000,000 EUR
Transacties met een omvang tussen 1,000,000 EUR (inbegrepen) en 10,000,000 EUR (niet inbegrepen)	[1,000,000 – 1,500,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 1,000,000 EUR en kleiner dan 1,500,000 EUR
	[1,500,000 – 2,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 1,500,000 EUR en kleiner dan 2,000,000 EUR
	[Z– Z+ 500,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan Z EUR en kleiner dan Z + 500,000 EUR (trap van 500,000 EUR)
	[9,500,000 – 10,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 9,500,000 EUR en kleiner dan 10,000,000 EUR

Omvang	Transactieomvangsegment	Definitie
Transacties met een omvang tussen 10,000,000 (inbegrepen) en 100,000,000 (niet inbegrepen)	[10,000,000 – 15,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 10,000,000 EUR en kleiner dan 15,000,000 EUR
	[15,000,000 – 20,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 15,000,000 EUR en kleiner dan 20,000,000 EUR
	[W– W + 5,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan W EUR en kleiner dan W + 5,000,000 EUR (trap van EUR 5,000,000)
	[95,000,000 – 100,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 95,000,000 EUR en kleiner dan 100,000,000 EUR
Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 100,000,000	[100,000,000 – 125,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 100,000,000 EUR en kleiner dan 125,000,000 EUR
	[125,000,000 – 150,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 125,000,000 EUR en kleiner dan 150,000,000 EUR
	[X – X + 25,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan X EUR en kleiner dan X + 25,000,000 EUR (trap van 25,000,000 EUR)
...

Tabel 4

Bereik van de transactieomvangsegmenten voor emissierechten en emissierechtenderivaten

Omvang	Transactieomvangsegment	Definitie
Transacties met een omvang tussen 0 en 1,000,000 (niet inbegrepen)]0 – 100,000[Transacties met een omvang van minder dan 100,000 ton kooldioxide-equivalent (tCO ₂ e)
	[100,000 – 100,000]	Transacties met een omvang gelijk aan 100,000 tCO ₂ e
]100,000 – 200,000[Transacties met een omvang groter dan 100,000 tCO ₂ e en kleiner dan 200,000 tCO ₂ e
	[200,000 – 300,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 200,000 tCO ₂ e en kleiner dan 300,000 tCO ₂ e
	[300,000 – 400,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 300,000 tCO ₂ e en kleiner dan 400,000 tCO ₂ e
	[Y – Y + 100,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan Y tCO ₂ e en kleiner dan Y + 100,000 tCO ₂ e (trap van 100,000 tCO ₂ e)
	[900,000 – 1,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 900,000 tCO ₂ e en kleiner dan 1,000,000 tCO ₂ e

Omvang	Transactieomvangsegment	Definitie
Transacties met een omvang tussen 1,000,000 tCO ₂ e (inbegrepen) en 10,000,000 tCO ₂ e (niet inbegrepen)	[1,000,000 – 1,500,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 1,000,000 tCO ₂ e en kleiner dan 1,500,000 tCO ₂ e
	[1,500,000 – 2,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 1,500,000 tCO ₂ e en kleiner dan 2,000,000 tCO ₂ e
	[Z– Z+ 500,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan Z tCO ₂ e en kleiner dan Z + 500,000 tCO ₂ e (trap van 500,000 tCO ₂ e)
	[9,500,000 – 10,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 9,500,000 tCO ₂ e en kleiner dan 10,000,000 tCO ₂ e
Transacties met een omvang tussen 10,000,000 tCO ₂ e (inbegrepen) en 100,000,000 tCO ₂ e (niet inbegrepen)	[10,000,000 – 15,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 10,000,000 tCO ₂ e en kleiner dan 15,000,000 tCO ₂ e
	[15,000,000 – 20,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 15,000,000 tCO ₂ e en kleiner dan 20,000,000 tCO ₂ e
	[W – W + 5,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan W tCO ₂ e en kleiner dan W + 5,000,000 tCO ₂ e (trap van 5,000,000 tCO ₂ e)
	[95,000,000 – 100,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 95,000,000 tCO ₂ e en kleiner dan 100,000,000 tCO ₂ e
Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 100,000,000 tCO ₂ e	[100,000,000 – 125,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 100,000,000 tCO ₂ e en kleiner dan 125,000,000 tCO ₂ e
	[125,000,000 – 150,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan 125,000,000 tCO ₂ e en kleiner dan 150,000,000 tCO ₂ e
	[X – X + 25,000,000[Transacties met een omvang groter dan of gelijk aan X tCO ₂ e en kleiner dan X + 25,000,000 tCO ₂ e (trap van 25,000,000 tCO ₂ e)
...”.