

Den här texten är endast avsedd som ett dokumentationshjälpmedel och har ingen rättslig verkan. EU-institutionerna tar inget ansvar för innehållet. De autentiska versionerna av motsvarande rättsakter, inklusive ingresserna, publiceras i Europeiska unionens officiella tidning och finns i EUR-Lex. De officiella texterna är direkt tillgängliga via länkarna i det här dokumentet

► **B** KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU) 2017/583

av den 14 juli 2016

om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 avseende tekniska tillsynsstandarder när det gäller krav på transparens för handelsplatser och värdepappersföretag för obligationer, strukturerade finansiella produkter, utsläppsrätter och derivat

(Text av betydelse för EES)

(EUT L 87, 31.3.2017, s. 229)

Ändrad genom:

		Officiella tidningen		
		nr	sida	datum
► <u>M1</u>	Kommissionens delegerade förordning (EU) 2021/529 av den 18 december 2020	L 106	47	26.3.2021
► <u>M2</u>	Kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/629 av den 12 januari 2022	L 115I	1	13.4.2022
► <u>M3</u>	Kommissionens delegerade förordning (EU) 2023/945 av den 17 januari 2023	L 131	17	16.5.2023

Rättad genom:

► **C1** Rättelse, EUT L 90102, 21.11.2023, s. 1 (2023/945)



**KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU)
2017/583**

av den 14 juli 2016

om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 avseende tekniska tillsynsstandarder när det gäller krav på transparens för handelsplatser och värdepappersföretag för obligationer, strukturerade finansiella produkter, utsläppsrätter och derivat

(Text av betydelse för EES)

KAPITEL I

DEFINITIONER

Artikel 1

Definitioner

I denna förordning gäller följande definitioner:

1. *paketransaktion*: antingen

- a) en transaktion avseende ett derivatkontrakt eller annat finansiellt instrument som förutsätter samtidigt genomförande av en transaktion avseende motsvarande mängd underliggande fysisk tillgång (*Exchange for Physical* eller *EFP*), eller
- b) en transaktion som inbegriper två eller flera sammansatta transaktioner avseende finansiella instrument, och
 - i) som ingås mellan två eller fler parter,
 - ii) där varje komponent i transaktionen bär en relevant ekonomisk eller finansiell risk som hänger samman med samtliga övriga komponenter,
 - iii) där leveransen av varje komponent sker samtidigt och beroende av leveransen av alla de övriga komponenterna.

2. *RFQ-system*: ett handelssystem där följande villkor uppfylls:

- a) En medlem eller aktör har lämnat bud till följd av en anbudsfrågan från en eller flera andra medlemmar eller aktörer.
- b) Budet är endast verkställbart av den medlem eller aktör som lämnat anbudsfrågan.
- c) Den medlem eller marknadsaktör som lämnat anbudsfrågan får genomföra en transaktion genom att godkänna det eller de bud som inkommit på dess begäran.

3. *röstbaserat handelssystem*: ett handelssystem där transaktioner mellan medlemmar ingås genom röstbaserad förhandling.

▼B

KAPITEL II

**TRANSPARENS FÖRE HANDEL AVSEENDE REGLERADE
MARKNADER, MULTILATERALA HANDELSPLATTFORMAR OCH
ORGANISERADE HANDELSPLATTFORMAR***Artikel 2***Krav på transparens före handel**

(Artikel 8.1 och 8.2 i förordning (EU) nr 600/2014)

Marknadsoperatörer och värdepappersföretag som driver en handelsplats ska offentliggöra köp- och säljbud och orderdjupet vid dessa priser, i enlighet med den typ av handelssystem de använder samt informationskraven i bilaga I.

*Artikel 3***Order av större omfattning**

(Artikel 9.1 a i förordning (EU) nr 600/2014)

En order är av större omfattning än normalt på marknaden om den, vid utförandet av ordern eller efter varje ändring av ordern, är lika stor eller större än den minimistorlek på order som fastställs i enlighet med metoden i artikel 13.

*Artikel 4***Typ av och minimistorlek på order som hålls i en
orderhanteringsfacilitet**

(Artikel 9.1 a i förordning (EU) nr 600/2014)

1. Den typ av order som genom en orderhanteringsfacilitet på handelsplatsen hålls dold i avvaktan på att den senare ska visas, och för vilken undantag från kraven på transparens före handel kan begäras, är en order som

- a) är avsedd att visas i den orderbok som drivs av handelsplatsen och som är beroende av objektiva villkor som fördefinierats av systemets protokoll,
- b) inte interagerar med andra köp- och säljintressen innan den offentliggjorts i den orderbok som drivs av handelsplatsen,
- c) när den har visats i orderboken interagerar med andra order i enlighet med de regler som gäller för order av den typen vid tidpunkten för offentliggörandet.

2. Minimistorleken på order som genom en orderhanteringsfacilitet på en handelsplats hålls dolda i avvaktan på att de senare ska visas och för vilka det kan göras undantag från kraven på transparens före handel ska, vid registreringen och efter alla eventuella ändringar, ha någon av följande storlekar:

▼ B

- a) När det gäller en reservorder, en storlek som är större än eller lika med 10 000 euro.

 - b) När det gäller alla andra order, en storlek som är större än eller lika med den minsta omsättningsbara kvantitet som fastställts på förhand av systemoperatören enligt dess regler och protokoll.
3. En reservorder, som avses i punkt 2 a, ska anses vara en limitorder bestående av en offentliggjord order som avser en del av en kvantitet och en ej offentliggjord order som avser den resterande kvantiteten om den kvantitet som ej offentliggjorts endast kan utföras efter att ha släppts till orderboken som en ny offentliggjord order.

▼ M3

4. Vid tillämpning av punkt 2 a ska storleken på order som hålls i en orderhanteringsfacilitet mätas som det teoretiska beloppet av de handlade kontrakten enligt bilaga II, tabell 2, fält 10.

▼ B*Artikel 5***Storlek som är specifik för det finansiella instrumentet**

(Artiklarna 8.4 och 9.1 b i förordning (EU) nr 600/2014)

1. En genomförbar intresseanmälan är större än storleken som är specifik för det finansiella instrumentet om den, vid utförandet eller efter ändringar, är minst lika stor som minimistorleken för en sådan genomförbar intresseanmälan som fastställs i enlighet med metoden i artikel 13.

2. Preliminära priser före handel för en genomförbar intresseanmälan som är större än storleken som är specifik för det finansiella instrumentet enligt punkt 1 och mindre än relevant storlek för större omfattning enligt artikel 3 ska anses ligga nära orderpriset om handelsplatsen offentliggör
 - a) bästa tillgängliga pris,

 - b) det aritmetiska medelvärdet av priserna, och

 - c) ett genomsnittspris som är viktat på grundval av volym, pris, tid och antalet genomförbara intresseanmälningar.

3. Marknadsoperatörer och värdepappersföretag som driver en handelsplats ska offentliggöra beräkningsmetoden för priser före handel och tidpunkten för offentliggörande när preliminära priser före handel anges och uppdateras.

▼B*Artikel 6***Kategorier av finansiella instrument för vilka det saknas en likvid marknad**

(Artikel 9.1 c i förordning (EU) nr 600/2014)

Ett finansiellt instrument eller en kategori av finansiella instrument ska anses sakna en likvid marknad om så fastställs på grundval av metoden i artikel 13.

KAPITEL III

TRANSPARENS EFTER HANDEL FÖR HANDELSPLATSER OCH VÄRDEPAPPERSFÖRETAG SOM HANDLAR UTANFÖR EN HANDELSPLATS*Artikel 7***Krav på transparens efter handel**

(Artiklarna 10.1, 21.1 och 21.5 i förordning (EU) nr 600/2014)

1. Värdepappersföretag som handlar utanför en handelsplats regler och marknadsoperatörer och värdepappersföretag som driver en handelsplats ska för varje transaktion offentliggöra uppgifter enligt tabellerna 1 och 2 i bilaga II och använda varje tillämplig flagga i tabell 3 i bilaga II.
2. Om en tidigare offentliggjord handelsrapport annulleras ska värdepappersföretag som handlar utanför en handelsplats och marknadsoperatörer och värdepappersföretag som driver en handelsplats offentliggöra en ny handelsrapport som innehåller alla uppgifter i den ursprungliga handelsrapporten och den flagga för annullering som anges i tabell 3 i bilaga II.
3. Om en tidigare offentliggjord handelsrapport ändras ska värdepappersföretag som handlar utanför en handelsplats samt marknadsoperatörer och värdepappersföretag som driver en handelsplats offentliggöra följande information:
 - a) En ny handelsrapport som innehåller alla uppgifter i den ursprungliga handelsrapporten och den flagga för annullering som anges i tabell 3 i bilaga II.
 - b) En ny handelsrapport som innehåller alla uppgifter i den ursprungliga handelsrapporten med alla nödvändiga korrigeringar och den flagga för ändring som anges i tabell 3 i bilaga II.
4. Information efter handel ska offentliggöras så nära realtid som det är tekniskt möjligt och under alla omständigheter
 - a) under de första tre åren av tillämpning av förordning (EU) nr 600/2014, inom 15 minuter efter genomförandet av berörd transaktion,
 - b) därefter inom fem minuter efter genomförandet av berörd transaktion.

▼B

5. Om en transaktion mellan två värdepappersföretag genomförs utanför reglerna för en handelsplats, antingen för egen räkning eller för kundens räkning, ska endast det värdepappersföretag som säljer det berörda finansiella instrumentet offentliggöra transaktionen genom en APA.

6. Med avvikelse från punkt 5 gäller att om endast ett av de värdepappersföretag som är en part i transaktionen är en systematisk internhandlare i det givna finansiella instrumentet och agerar som det köpande företaget ska endast det företaget offentliggöra transaktionen genom en APA och informera säljaren om den vidtagna åtgärden.

7. Värdepappersföretag ska vidta alla rimliga åtgärder för att säkerställa att transaktionen offentliggörs som en enda transaktion. Två matchande affärer som en och samma mellanhand genomför samtidigt och till samma pris ska därför betraktas som en enda transaktion.

8. Information som avser en pakettransaktion ska offentliggöras med avseende på varje komponent så nära realtid som det är tekniskt möjligt, med beaktande av behovet att allokera priser till enskilda finansiella instrument samt inbegripa flaggan för pakettransaktionen eller flaggan för utbyte av fysiska varor enligt tabell 3 i bilaga II. Om pakettransaktionen uppfyller kraven för uppskjutet offentliggörande enligt artikel 8 ska information om samtliga komponenter offentliggöras efter det att uppskjutandeperioden för transaktionen löpt ut.

*Artikel 8***Uppskjutet offentliggörande av transaktioner**

(Artiklarna 11.1, 11.3 och 21.4 i förordning (EU) nr 600/2014)

1. Om en behörig myndighet ger tillstånd att skjuta upp offentliggörandet av uppgifter, i enlighet med artikel 11.1 i förordning (EU) nr 600/2014, ska värdepappersföretag som verkar utanför en handelsplats samt marknadsoperatörer och värdepappersföretag som driver en handelsplats offentliggöra varje transaktion senast kl. 19.00, lokal tid, den andra arbetsdagen efter den dag då transaktionen ägde rum, förutsatt att följande villkor uppfylls:

- a) Transaktionen är av större omfattning än normalt på marknaden, enligt artikel 9.
- b) Transaktionen är ett finansiellt instrument eller en kategori av finansiella instrument som saknar en likvid marknad i enlighet med metoden i artikel 13.
- c) Transaktionen ingås mellan ett värdepappersföretag – som handlar för egen räkning och där handeln inte är matchad principhandel enligt artikel 4.1.38 i Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU ⁽¹⁾ – och en annan motpart, och är större än den storlek som är specifik för det finansiella instrumentet enligt artikel 10.

⁽¹⁾ Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU av den om marknader för finansiella instrument och om ändring av direktiv 2002/92/EG och av direktiv 2011/61/EU (EUT L 173, 12.6.2014, s. 349).

▼B

- d) Transaktionen är en pakettransaktion som uppfyller ett av följande kriterier:
- i) En eller flera av dess komponenter är transaktioner avseende finansiella instrument för vilka det saknas en likvid marknad.
 - ii) En eller flera komponenter är transaktioner avseende ett finansiellt instrument som är av större omfattning än normalt på marknaden, enligt artikel 9.
 - iii) Transaktionen ingås mellan ett värdepappersföretag – som handlar för egen räkning och där handeln inte är matchad principhandel enligt artikel 4.1.38 i direktiv 2014/65/EU – och en annan motpart, och en eller flera av dess komponenter är transaktioner avseende finansiella instrument som är större än den storlek som är specifik för instrumentet, enligt artikel 10.

2. När den tidsfrist som fastställs enligt punkt 1 har löpt ut ska alla uppgifter om transaktionen offentliggöras såvida inte en utökad eller obestämd tidsperiod för uppskjutande beviljas, i enlighet med artikel 11.

3. Om en transaktion mellan två värdepappersföretag, antingen för egen räkning eller för kundens räkning, genomförs utanför handelsplatsens regler ska den berörda behöriga myndigheten, i syfte att fastställa tillämpliga regler för uppskjutande, vara behörig myndighet för det värdepappersföretag som ansvarar för att genom en APA offentliggöra handeln i enlighet med artikel 7.5, 7.6 och 7.7

*Artikel 9***Transaktioner av större omfattning**

(Artikel 11.1 a i förordning (EU) nr 600/2014)

En transaktion ska anses vara av större omfattning än normalt på marknaden om den är lika stor eller större än den minimistorlek på transaktion som fastställs i enlighet med metoden i artikel 13.

*Artikel 10***Storlek som är specifik för det finansiella instrumentet**

(Artikel 11.1 c i förordning (EU) nr 600/2014)

En transaktion ska anses vara större än storleken som är specifik för det finansiella instrumentet om den är lika stor eller större än den minimistorlek på transaktion som fastställs i enlighet med metoden i artikel 13.

*Artikel 11***Krav på transparens i samband med uppskjutet offentliggörande med behörig myndighets tillstånd**

(Artikel 11.3 i förordning (EU) nr 600/2014)

1. Om behöriga myndigheter utövar sina befogenheter i samband med ett tillstånd om uppskjutet offentliggörande, i enlighet med artikel 11.3 i förordning (EU) nr 600/2014, ska följande gälla:

▼B

- a) Om artikel 11.3 a i förordning (EU) nr 600/2014 tillämpas ska de behöriga myndigheterna begära offentliggörande av var och en av följande uppgifter under hela tidsperioden för uppskjutandet, i enlighet med artikel 8:
- i) Alla de uppgifter om en transaktion som anges i tabellerna 1 och 2 i bilaga II, med undantag för uppgifter som avser volym.
 - ii) Transaktioner i aggregerad form på dagsbasis vid ett minimiantal av fem transaktioner som utförs samma dag, för offentliggörande följande dag före kl. 09.00 lokal tid.
- b) Om artikel 11.3 b i förordning (EU) nr 600/2014 tillämpas ska behöriga myndigheter tillåta att enskilda transaktioners volym inte offentliggörs under en förlängd tidsperiod av fyra veckor.
- c) För icke aktierelaterade instrument som inte är statspapper och om artikel 11.3 c i förordning (EU) nr 600/2014 tillämpas ska behöriga myndigheter, under en förlängd uppskjutandeperiod av fyra veckor, tillåta att flera transaktioner som utförts under en kalendervecka offentliggörs i aggregerad form före kl. 09.00 lokal tid påföljande tisdag.
- d) För statspapper, och om artikel 11.3 d i förordning (EU) nr 600/2014 tillämpas, ska behöriga myndigheter på obestämd tid tillåta att flera transaktioner som utförts under en kalendervecka offentliggörs i aggregerad form före kl. 09.00 lokal tid påföljande tisdag.
2. Om den förlängda uppskjutandeperiod som avses i punkt 1 b har löpt ut ska följande krav tillämpas:
- a) För alla instrument som inte är statspapper ska offentliggörande av samtliga uppgifter för varje enskild transaktion ske före kl. 09.00 lokal tid påföljande arbetsdag.
- b) Om de behöriga myndigheterna väljer att för statspapper inte använda de möjligheter som föreskrivs i artikel 11.3 b och därefter i artikel 11.3 d i förordning (EU) nr 600/2014, i enlighet med andra stycket i artikel 11.3 i förordning (EU) nr 600/2014, ska offentliggörande av samtliga uppgifter för varje enskild transaktion ske före kl. 09.00 lokal tid påföljande arbetsdag.
- c) Om de behöriga myndigheterna väljer att för statspapper tillämpa de möjligheter som föreskrivs i artikel 11.3 b och därefter i artikel 11.3 d i förordning (EU) nr 600/2014, i enlighet med andra stycket i artikel 11.3 i förordning (EU) nr 600/2014, ska offentliggörande av flera transaktioner som utförts under en kalendervecka ske i aggregerad form före kl. 09.00 på tisdagen efter utgången av den förlängda uppskjutandeperioden på fyra veckor räknat från den sista dagen på kalenderveckan.
3. För alla instrument som inte är statspapper ska samtliga uppgifter för varje enskild transaktion offentliggöras fyra veckor efter offentliggörandet av uppgifterna i aggregerad form, i enlighet med punkt 1 c, senast kl. 09.00 lokal tid.

▼B

4. De aggregerade data på dags- eller veckobasis som avses i punkterna 1 och 2 ska för obligationer, strukturerade finansiella produkter, derivat och utsläppsrätter innehålla följande information med avseende på varje dag eller vecka i den berörda kalenderperioden:

- a) Det genomsnittliga viktade priset.
- b) Den totala handelsvolymen, som avses i tabell 4 i bilaga II.
- c) Det totala antalet transaktioner.

5. Transaktionerna ska aggregeras per ISIN-kod. Om ISIN-kod saknas ska transaktionerna aggregeras per kategori av finansiella instrument på vilka det likviditetstest som föreskrivs i artikel 13 är tillämpligt.

6. Om den veckodag som fastställs för offentliggörande enligt punkterna 1 c och d, 2 och 3 inte är en arbetsdag ska offentliggörandet ske påföljande arbetsdag före kl. 09.00 lokal tid.

▼M3*Artikel 12***Tillämpning av transparens efter handel för vissa transaktioner som genomförs utanför en handelsplats**

(Artikel 21.1 i förordning (EU) nr 600/2014)

De skyldigheter som anges i artikel 21.1 i förordning (EU) nr 600/2014 ska inte vara tillämpliga på transaktioner som förtecknas i artikel 2.5 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 ⁽¹⁾.

▼B

KAPITEL IV

BESTÄMMELSER SOM ÄR GEMENSAMMA FÖR TRANSPARENS FÖRE OCH EFTER HANDEL*Artikel 13***Metod för transparensberäkningar**

(Artiklarna 9.1, 9.2, 11.1 och 22.1 i förordning (EU) nr 600/2014)

1. För klassificering av finansiella instrument eller kategorier av finansiella instrument för vilka det saknas en likvid marknad, i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b, ska följande metoder tillämpas i fråga om alla tillgångsklasser:

- a) Statisk bestämning av likviditet för
 - i) tillgångsklassen värdepapperiserade derivat enligt tabell 4.1 i bilaga III,

⁽¹⁾ Kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/590 av den 28 juli 2016 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 avseende tekniska tillsynsstandarder för rapportering av transaktioner till behöriga myndigheter (EUT L 87, 31.3.2017, s. 449).

▼B

- ii) följande underklasser till tillgångsklassen aktiederivat: aktieindexoptioner, aktieindexterminer, aktieoptioner, aktieterminer, aktieutdelningsoptioner, aktieutdelningsterminer, volatilitetsindexoptioner, volatilitetsindexterminer, ETF-optioner, ETF-terminer och andra aktiederivat enligt tabell 6.1 i bilaga III,
 - iii) tillgångsklassen valutaderivat enligt tabell 8.1 i bilaga III,
 - iv) underklasser till tillgångsklasserna övriga räntederivat, övriga råvaruderivat, övriga kreditderivat, övriga C10-derivat, övriga CFD-kontrakt, övriga utsläppsrätter och övriga utsläppsrättsderivat, enligt tabellerna 5.1, 7.1, 9.1, 10.1, 11.1, 12.1 och 13.1 i bilaga III.
- b) Regelbunden bedömning på grundval av kvantitativa och, i förekommande fall, kvalitativa likviditetskriterier för
- i) alla obligationstyper utom börshandlade certifikat (*ETC* och *ETN*) enligt tabell 2.1 i bilaga III och som närmare definieras i artikel 17.1,
 - ii) obligationer av typen *ETC* och *ETN*, enligt tabell 2.4 i bilaga III,
 - iii) tillgångsklassen räntederivat utom underklassen övriga räntederivat, enligt tabell 5.1 i bilaga III,
 - iv) följande underklasser till tillgångsklassen aktiederivat: swappar och portföljswappar, enligt tabell 6.1 i bilaga III,
 - v) tillgångsklassen råvaruderivat utom underklassen övriga råvaruderivat, enligt tabell 7.1 i bilaga III,
 - vi) följande underklasser till tillgångsklassen kreditderivat: indexerade kreditswappar och kreditswappar som refererar till ett enda namn, enligt tabell 9.1 i bilaga III,
 - vii) tillgångsklassen C10-derivat utom underklassen övriga C10-derivat, enligt tabell 10.1 i bilaga III,
 - viii) följande underklasser till tillgångsklassen CDF-kontrakt: valuta-CDF:er och råvaru-CDF:er, enligt tabell 11.1 i bilaga III,
 - ix) tillgångsklassen utsläppsrätter utom underklassen andra utsläppsrätter, enligt tabell 12.1 i bilaga III,
 - x) tillgångsklassen utsläppsrättsderivat utom underklassen övriga utsläppsrättsderivat, enligt tabell 13.1 i bilaga III.
- c) Regelbunden bedömning på grundval av kvalitativa likviditetskriterier för

▼B

- i) följande underklasser till tillgångsklassen kreditderivat: optioner på indexerade creditswappar och optioner på creditswappar som refererar till ett enda namn, enligt tabell 9.1 i bilaga III,
 - ii) följande underklasser till tillgångsklassen CFD-kontrakt: aktie-CDF:er, obligations-CDF:er, aktietermins-CDF:er och aktieoptions-CDF:er, enligt tabell 11.1 i bilaga III.
- d) Regelbunden bedömning på grundval av två testmetoder för strukturerade finansiella produkter, enligt tabell 3.1 i bilaga III.
2. För att fastställa storleken som är specifik för det finansiella instrumentet, som avses i artikel 5, och order av större omfattning än normalt på marknaden, som avses i artikel 3, ska följande metoder tillämpas:
- a) Tröskelvärdet för
 - i) obligationer av typen ETC och ETN, enligt tabell 2.5 i bilaga III,
 - ii) tillgångsklassen värdepapperiserade derivat, enligt tabell 4.2 i bilaga III,
 - iii) varje underklass till aktiederivat, enligt tabellerna 6.2 och 6.3 i bilaga III,
 - iv) varje underklass till valutaderivat, enligt tabell 8.2 i bilaga III.
 - v) varje underklass, som anses sakna en likvid marknad, till tillgångsklasserna räntederivat, råvaruderivat, kreditderivat, C10-derivat och CDF-kontrakt, enligt tabellerna 5.3, 7.3, 9.3, 10.3 och 11.3 i bilaga III,
 - vi) varje underklass, som anses sakna en likvid marknad, till tillgångsklasserna utsläppsrätter och utsläppsrättsderivat, enligt tabellerna 12.3 och 13.3 i bilaga III,
 - vii) varje strukturerad finansiell produkt som inte blivit godkänd i test-1 enligt punkt 1 d i tabell 3.2 i bilaga III,
 - viii) varje strukturerad finansiell produkt, som anses sakna en likvid marknad, som endast blivit godkänd i test-1 enligt punkt 1 d i tabell 3.3 i bilaga III.
 - b) Den större av handelsstorleken under vilken den procentandel av de transaktioner som motsvarar den handelspercentil som närmare anges i artikel 17.3 ligger, och det lägsta tröskelvärdet för
 - i) varje obligationstyp utom ETC:er och ETN:er enligt tabell 2.3 i bilaga III,
 - ii) varje underklass, som har en likvid marknad, till tillgångsklasserna räntederivat, råvaruderivat, kreditderivat, C10-derivat och CDF-kontrakt, enligt tabellerna 5.2, 7.2, 9.2, 10.2 och 11.2 i bilaga III,

▼B

- iii) varje underklass, som har en likvid marknad, till tillgångsklasserna utsläppsrätter och utsläppsrättsderivat, enligt tabellerna 12.2 och 13.2 i bilaga III,
 - iv) varje strukturerad finansiell produkt, som anses ha en likvid marknad, som blivit godkänd i test-1 och test-2 enligt punkt 1 d i enlighet med tabell 3.3 i bilaga III.
3. För att fastställa storleken som är specifik för det finansiella instrumentet, som avses i artikel 8.1 c, och transaktioner av större omfattning än normalt på marknaden, som avses i artikel 8.1 a, ska följande metoder tillämpas:
- a) Tröskelvärdet för
 - i) obligationer av typen ETC och ETN, enligt tabell 2.5 i bilaga III,
 - ii) tillgångsklassen värdepapperiserade derivat, enligt tabell 4.2 i bilaga III,
 - iii) varje underklass till aktiederivat, enligt tabellerna 6.2 och 6.3 i bilaga III,
 - iv) varje underklass till valutaderivat, enligt tabell 8.2 i bilaga III,
 - v) varje underklass, som anses sakna en likvid marknad, till tillgångsklasserna räntederivat, råvaruderivat, kreditderivat, C10-derivat och CDF-kontrakt, enligt tabellerna 5.3, 7.3, 9.3, 10.3 och 11.3 i bilaga III,
 - vi) varje underklass, som anses sakna en likvid marknad, till tillgångsklasserna utsläppsrätter och utsläppsrättsderivat, enligt tabellerna 12.3 och 13.3 i bilaga III,
 - vii) varje strukturerad finansiell produkt som inte blivit godkänd i test-1 enligt punkt 1 d i tabell 3.2 i bilaga III,
 - viii) varje strukturerad finansiell produkt, som anses sakna en likvid marknad, som endast blivit godkänd i test-1 enligt punkt 1 d i tabell 3.3 i bilaga III.
 - b) Handelsstorleken under vilken den procentandel av de transaktioner som motsvarar handelspercentilen för varje obligationstyp utom ETC:er och ETN:er ligger, enligt tabell 2.3 i bilaga III.
 - c) Den största av handelsstorleken under vilken den procentandel av de transaktioner som motsvarar handelspercentilen ligger, handelsstorleken under vilken procentandelen av den volym som motsvarar volympercentilen ligger och det lägsta tröskelvärdet för varje underklass, som anses ha en likvid marknad, till tillgångsklasserna räntederivat, råvaruderivat, kreditderivat, C10-derivat och CFD-kontrakt, enligt tabellerna 5.2, 7.2, 9.2, 10.2 och 11.2 i bilaga III.

▼B

- d) Den större av handelsstorleken under vilken procentandelen för de transaktioner som motsvarar handelspercentilen ligger och det lägsta tröskelvärdet för
- i) varje underklass, som anses sakna en likvid marknad, till tillgångsklasserna utsläppsätter och utsläppsderivat, enligt tabellerna 12.2 och 13.2 i bilaga III,
 - ii) varje strukturerad finansiell produkt, som anses ha en likvid marknad, som blivit godkänd i test-1 och test-2 enligt punkt 1 d i enlighet med tabell 3.3 i bilaga III.

4. Om handelsstorleken som motsvarar volympercentilen för fastställande av transaktionen som är av större omfattning än normalt på marknaden, vid tillämpningen av punkt 3 c, är högre än den 97,5:e handelspercentilen får handelsstorleken inte beaktas och den storlek som är specifik för det finansiella instrumentet, som avses i artikel 8.1 c, och den storlek på transaktioner av större omfattning än normalt på marknaden, som avses i artikel 8.1 a ska anses vara den större av handelsstorleken under vilken procentandelen av de transaktioner som motsvarar handelspercentilet ligger och det lägsta tröskelvärdet.

5. I enlighet med de delegerade förordningarna (EU) 2017/590 och (EU) 2017/577 ska behöriga myndigheter på daglig basis samla in sådana data från handelsplatser, APA:er och CTP:er som är nödvändig för att utföra beräkningar för att fastställa

- a) de finansiella instrument och kategorier av finansiella instrument som saknar likvida marknader, enligt punkt 1,
- b) de storlekar av större omfattning än normalt på marknaden och den storlek som är specifik för instrumentet, enligt punkterna 2 och 3.

▼M3

De data som avses i första stycket ska samlas in i enlighet med bilaga V.

▼B

6. Behöriga myndigheter som utför beräkningarna för en kategori av finansiella instrument ska upprätta samarbetsarrangemang sinsemellan för att säkerställa aggregeringen av sådana uppgifter inom hela unionen som är nödvändiga för beräkningarna.

7. Vid tillämpningen av punkterna 1 b och d, 2 b, 3 b, c och d ska behöriga myndigheter ta med i beräkningen de transaktioner som utförts inom unionen mellan den 1 januari och den 31 december föregående år.

8. Den handelsstorlek som avses i punkterna 2 b, 3 b, c och d ska fastställas enligt de volymmått som anges i tabell 4 i bilaga II. Om den handelsstorlek som avses i punkterna 2 och 3 uttrycks i penningvärde och det finansiella instrumentet inte är angivet i euro ska handelsstorleken räknas om till den valuta i vilken det finansiella instrumentet är angivet genom tillämpning av Europeiska centralbankens referensväxelkurs per den 31 december föregående år.

▼B

9. Marknadsoperatörer och värdepappersföretag som driver en handelsplats får räkna om de handelsstorlekar som fastställts i enlighet med punkterna 2 och 3 till motsvarande antal – av den handelsplatsen på förhand fastställda – delar för respektive underklass eller underklass till en tillgångsklass. Marknadsoperatörer och värdepappersföretag som driver en handelsplats får hålla denna typ av handelsstorlekar till och med tillämpningen av resultaten från nästa beräkningar som utförs i enlighet med punkt 17.

10. De beräkningar som avses i punkterna 2 b i och 3 b får inte avse transaktioner som uppgår till 100 000 euro eller mindre.

11. För de fastställanden som avses i punkterna 2 och 3 får inte punkterna 2 b och 3 b, c och d tillämpas om antalet transaktioner för beräkningar är mindre än 1 000, varvid följande tröskelvärden ska gälla:

- a) 100 000 euro för alla typer av obligationer utom ETC:er och ETN:er.
- b) De tröskelvärden som anges i punkterna 2 a och 3 a, för alla andra finansiella instrument än de som avses av led a i denna punkt.

12. De beräkningar som avses i punkterna 2 b och 3 b, c och d ska, såvida de inte avser utsläppsrätter eller utsläppsrätsderivat, avrundas uppåt till nästa

- a) 100 000 om tröskelvärdet är mindre än 1 miljon,
- b) 500 000 om tröskelvärdet är 1 miljon eller större men mindre än 10 miljoner,
- c) 5 miljoner om tröskelvärdet är 10 miljon eller större men mindre än 100 miljoner,
- d) 25 miljoner om tröskelvärdet är 100 miljoner eller större.

13. Vid tillämpning av punkt 1 ska de kvantitativa likviditetskriterier som anges för var och en av tillgångsklasserna i bilaga III fastställas i enlighet med avsnitt 1 i bilaga III.

14. För aktiederivat – som upptagits för handel eller först handlats på en handelsplats och som inte ingår i en underklass för vilken den storlek som är specifik för det finansiella instrumentet, som avses i artiklarna 5 och 8.1 c, och den storlek på order och transaktioner av större omfattning jämfört med normalt på marknaden, som avses i artiklarna 3 och 8.1 a har offentliggjorts och som ingår i någon av de underklasser till tillgångsklasser som avses i punkt 1 a ii – ska den storlek som är specifik för det finansiella instrumentet och den storlek på order och transaktioner av större omfattning jämfört med normalt på marknaden vara tillämplig för det spann för genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) till vilket aktiederivatet hör.

▼B

15. Finansiella instrument som upptagits för handel eller först handlats på en handelsplats och som inte tillhör någon underklass till vilken den storlek som är specifik för det finansiella instrumentet som avses i artiklarna 5 och 8.1 c och den storlek på order och transaktioner av större omfattning jämfört med normalt på marknaden som avses i artiklarna 3 och 8.1 a har offentliggjorts, får inte anses ha en likvid marknad förrän resultaten av de beräkningar som utförts i enlighet med punkt 17 tillämpas. Den tillämpliga storlek som är specifik för det finansiella instrumentet, som avses i artiklarna 5 och 8.1 c och storleken på de order och transaktioner av större omfattning jämfört med normalt på marknaden, som avses i artiklarna 3 och 8.1 a ska vara storlekarna för underklasserna, som inte anses ha en likvid marknad, till samma tillgångsklass.

16. Efter slutet av handelsdagen men före slutet av dagen ska handelsplatserna förelägga de behöriga myndigheterna de uppgifter som avses i bilaga IV för utförande av de beräkningar som avses i punkt 5, så snart det finansiella instrumentet tagits upp för handel på den handelsplatsen eller så snart de uppgifter som tidigare lämnats in har ändrats.

▼M3

17. Behöriga myndigheter ska säkerställa offentliggörande av resultatet av de beräkningar som avses i punkt 5 för varje finansiellt instrument och kategori av finansiella instrument senast den 30 april året efter den dag då förordning EU nr 600/2014 börjar tillämpas och senast den 30 april varje år därefter. Resultaten av beräkningarna ska vara tillämpliga från och med den första måndagen i juni varje år efter offentliggörandet till och med dagen före den första måndagen i juni påföljande år.

18. Vid tillämpning av beräkningarna i punkt 1 b i och genom undantag av punkterna 7, 15 och 17, ska behöriga myndigheter, när det gäller obligationer, med undantag för ETC:er och ETN:er, säkerställa offentliggörande av de beräkningar som avses i punkt 5 a på kvartalsbasis, första måndagen i februari, maj, augusti respektive november efter den dag då förordning (EU) nr 600/2014 börjar tillämpas och första måndagen i februari, maj, augusti respektive november varje år därefter. Beräkningarna ska inbegripa transaktioner som utförts i unionen under föregående kalenderkvartal och ska tillämpas från och med den tredje måndagen i februari, maj, augusti och november varje år fram till tillämpningen av beräkningarna för efterföljande kvartalsperiod.

▼B

19. Obligationer, med undantag för ETC:er och ETN:er, som tagits upp för handel eller först handlats på en handelsplats under ett kvartals två första månader ska anses ha en likvid marknad enligt tabell 2.2 i bilaga III till dess resultaten av beräkningarna för kalenderkvartalet börjar tillämpas

20. Obligationer, med undantag för ETC:er och ETN:er, som tagits upp för handel eller först handlats på en handelsplats under ett kvartals sista månad ska anses ha en likvid marknad enligt tabell 2.2 i bilaga III till dess resultaten av beräkningarna för påföljande kalenderkvartal börjar tillämpas.

▼B*Artikel 14***Transaktioner som omfattas av undantaget i artikel 1.6 i förordning (EU) nr 600/2014**

(Artikel 1.6 i förordning (EU) nr 600/2014)

En transaktion ska anses utföras av en medlem av det Europeiska centralbankssystemet (ECBS) vid utövandet av penningpolitik, valutapolitik och finansiell stabilitetspolitik om transaktionen uppfyller något av följande krav:

- a) Transaktionen utförs i penningpolitiskt syfte, inbegripet transaktioner i enlighet med artiklarna 18 och 20 i stadgan för Europeiska centralbankssystemet och Europeiska centralbanken som fogats till fördraget om Europeiska unionen eller transaktioner som utförts enligt motsvarande nationella bestämmelser för ECBS-medlemsstater som inte har euron som valuta.
- b) Transaktionen är en valutatransaktion, inbegripet transaktioner som utförts i syfte att upprätthålla eller förvalta medlemsstaternas valuta-reserver samt sådana reservförvaltningstjänster som tillhandahålls av en ECBS-medlem till centralbanker i andra länder där undantaget har förlängts i enlighet med artikel 1.9 i förordning (EU) nr 600/2014.
- c) Transaktionen genomförs som ett led i finansiell stabilitetspolitik.

*Artikel 15***Transaktioner som inte omfattas av undantaget i artikel 1.6 i förordning (EU) nr 600/2014**

(Artikel 1.7 i förordning (EU) nr 600/2014)

Artikel 1.6 i förordning (EU) nr 600/2014 får inte tillämpas på följande typer av transaktioner som utförs av en medlem av ECBS för genomförande av en investering som är orelaterad med den medlemsstatens genomförande av en av de uppgifter som avses i artikel 14:

- a) Transaktioner som utförts för förvaltning av medlemmens egna medel.
- b) Transaktioner som utförs för administrativa ändamål eller för ECBS-medlemmens personal, bland annat transaktioner för förvaltning av ett pensionsprogram för personalen.
- c) Transaktioner som utförts för medlemmens investeringsportfölj enligt skyldigheter i nationell lagstiftning.

▼B*Artikel 16***Tillfälligt upphävande av tansparenskraven**

(Artikel 9.5 a i förordning (EU) nr 600/2014)

1. För finansiella instrument för vilka det finns en likvid marknad i enlighet med metoden i artikel 13 får en behörig myndighet tillfälligt upphäva de krav på transparens som föreskrivs i artiklarna 8 och 10 i förordning (EU) nr 600/2014 om den beräknade totala volymen för en kategori av obligationer, strukturerade finansiella produkter, utsläppsrätter eller derivat, som anges i tabell 4 i bilaga II, för de föregående 30 kalenderdagarna utgör mindre än 40 % av den genomsnittliga månatliga volym som beräknats för de tolv hela kalendermånader som föregått dessa 30 kalenderdagar.

2. För finansiella instrument för vilka det saknas en likvid marknad i enlighet med metoden i artikel 13 får en behörig myndighet tillfälligt upphäva de krav på transparens som föreskrivs i artiklarna 8 och 10 i förordning (EU) nr 600/2014 om den beräknade totala volymen för en kategori av obligationer, strukturerade finansiella produkter, utsläppsrätter eller derivat, som anges i tabell 4 i bilaga II, för de föregående 30 kalenderdagarna utgör mindre än 20 % av den genomsnittliga månatliga volym som beräknats för de tolv hela kalendermånader som föregått dessa 30 kalenderdagar.

3. Behöriga myndigheter ska vid utförandet av de beräkningar som avses i punkterna 1 och 2, beakta de transaktioner som utförts överallt inom unionen för berörda kategorier av obligationer, strukturerade finansiella produkter, utsläppsrätter eller derivat. Beräkningarna ska utföras på den nivå inom den kategori av finansiella instrument på vilka det likviditetstest som föreskrivs i artikel 13 är tillämpligt.

4. Innan de behöriga myndigheterna beslutar att upphäva kraven på transparens ska de säkerställa att den betydande likviditetsminskningen på alla platser inte beror på säsongseffekterna för ifrågavarande kategori av finansiella instrument med avseende på likviditet.

*Artikel 17***Bestämmelser för likviditetsbedömning av obligationer och för fastställande av storlek före handel för instruments tröskelvärden baserat på handelspercentiler****▼M2**

1. För fastställande av obligationer för vilka det saknas en likvid marknad för tillämpningen av artikel 6, och i enlighet med metoden i artikel 13.1 b, ska det tillämpade likviditetskriteriet ”genomsnittligt dagligt antal transaktioner” vara det ”genomsnittliga dagliga antal transaktioner” som motsvarar steg S3 (7 dagliga transaktioner).

▼B

2. Företagsobligationer och säkerställda obligationer som tagits upp för handel eller först handlats på en handelsplats ska anses ha en likvid marknad till dess resultaten av beräkningarna för det första kvartalets likviditetsfastställande, enligt artikel 13.18, om

- a) emissionsstorleken överstiger 1 000 000 000 euro under stegen S1 och S2, i enlighet med punkt 6,
- b) emissionsstorleken överstiger 500 000 000 euro under stegen S3 och S4, i enlighet med punkt 6,

▼M2

3. För fastställande av storlek som är specifik för det finansiella instrumentet för tillämpningen av artikel 5, och i enlighet med metoden i artikel 13.2 b i, ska den tillämpade handelspercentilen vara den handelspercentil som motsvarar steg S3 (50:e percentilen).

För fastställande av storlek som är specifik för det finansiella instrumentet för tillämpningen av artikel 5, och i enlighet med metoden i artikel 13.2 b ii–iv, ska den tillämpade handelspercentilen vara den handelspercentil som motsvarar steg S1 (30:e percentilen).

▼B

4. Esma ska senast den 30 juli året efter den dag då förordning (EU) nr 600/2014 börjar tillämpas och senast den 30 juli varje år därefter förelägga kommissionen en bedömning av genomförandet av tröskelvärdena för likviditetskriteriet ”genomsnittligt dagligt antal transaktioner” avseende obligationer och de handelspercentiler som fastställer storleken som är specifik för de finansiella instrumenten enligt punkt 8. Kravet att lämna in en bedömning av genomförandet av likviditetskriteriet för obligationer upphör så snart S4 i sekvensen i punkt 6 har nåtts. Kravet att lämna in en bedömning av handelspercentilerna upphör så snart S4 i sekvensen i punkt 8 har nåtts.

5. Den bedömning som avses i punkt 4 ska beakta

- a) utvecklingen av handelsvolymen för sådana icke aktierelaterade instrument som omfattas av kraven på transparens före handel enligt artiklarna 8 och 9 i förordning (EU) nr 600/2014,
- b) konsekvenserna för tillhandahållare av likviditet av det percentiltröskelvärde som används för att fastställa den storlek som är specifik för det finansiella instrumentet, och
- c) eventuella andra relevanta faktorer.

6. Esma ska mot bakgrund av den bedömning som avses i punkterna 4 och 5 förelägga kommissionen en ändrad version av de tekniska tillsynsstandarder som justerar tröskelvärdet för likviditetskriteriet ”genomsnittligt dagligt antal transaktioner” för obligationer enligt följande sekvens:

- a) S2 (tio transaktioner per dag) senast den 30 juli året efter den dag då förordning (EU) nr 600/2014 börjar tillämpas.

▼B

b) S3 (sju transaktioner per dag) senast den 30 juli året därefter.

c) S4 (två transaktioner per dag) senast den 30 juli året därefter.

7. Om Esmas inte lämnar in ändrade tekniska tillsynsstandarder som justerar tröskelvärdet för nästa steg enligt den sekvens som avses i punkt 6, ska det i Esmas bedömning, som avses i punkterna 4 och 5, förklaras varför en justering av tröskelvärdena inte är motiverad. I sådana fall kommer förflyttningen till nästa steg att skjutas upp ett år.

8. Esmas ska mot bakgrund av den bedömning som avses i punkterna 4 och 5 förelägga kommissionen en ändrad version av de tekniska tillsynsstandarder som justerar tröskelvärdet för handelspercentiler enligt följande sekvens:

a) S2 (40:e percentilen) senast den 30 juli året efter den dag då förordning (EU) nr 600/2014 börjar tillämpas.

b) S3 (50:e percentilen) senast den 30 juli året därefter.

c) S4 (60:e percentilen) senast den 30 juli året därefter.

9. Om Esmas inte lämnar in ändrade tekniska tillsynsstandarder som justerar tröskelvärdet för nästa steg enligt den sekvens som avses i punkt 8, ska det i Esmas bedömning, som avses i punkterna 4 och 5, förklaras varför en justering av tröskelvärdena inte är motiverad. I sådana fall kommer förflyttningen till nästa steg att skjutas upp ett år.

*Artikel 18***Övergångsbestämmelser**

1. Behöriga myndigheter ska senast sex månader före dagen då förordning (EU) nr 600/2014 börjar tillämpas samla in nödvändiga data, utföra beräkningar och säkerställa offentliggörande av de uppgifter som avses i artikel 13.5.

2. Vid tillämpning av punkt 1 gäller följande:

a) Beräkningarna ska baseras på en sexmånaders referensperiod som inleds 18 månader före den dag då förordning (EU) nr 600/2014 börjar tillämpas.

b) Resultaten av första offentliggörandets beräkningar ska användas till dess resultaten av de första regelbundna beräkningar som föreskrivs i artikel 13.17 börjar tillämpas.

3. Genom undantag från punkt 1 ska behöriga myndigheter när det gäller alla obligationer utom ETC:er och ETN:er vidta bästa möjliga åtgärder för att säkerställa offentliggörande av resultaten av de transparenberäkningar som närmare anges i artikel 13.1 b i, senast första dagen i månaden före den dag då förordning (EU) nr 600/2014 börjar tillämpas, på grundval av en referensperiod på tre månader med början första dagen i femte månaden före den dag då förordning (EU) nr 600/2014 börjar tillämpas.

▼B

4. Behöriga myndigheter, marknadsoperatörer och värdepappersföretag, inbegripet värdepappersföretag som driver en handelsplats, ska använda den information som publicerats i enlighet med punkt 3 till dess resultaten av den första regelbundna beräkning som föreskrivs i artikel 13.18 börjar tillämpas.

5. Obligationer, med undantag för ETC:er och ETN:er, som tagits upp för handel eller först handlats på en handelsplats under den tremånadersperiod som föregår den dag då förordning (EU) nr 600/2014 börjar tillämpas ska anses sakna en likvid marknad enligt tabell 2.2 i bilaga III till dess resultaten av de första regelbundna beräkningarna, som föreskrivs i artikel 13.18, börjar tillämpas.

*Artikel 19***Ikraftträdande och tillämpning**

Denna förordning träder i kraft den tjugonde dagen efter det att den har offentliggjorts i *Europeiska unionens officiella tidning*.

Den ska tillämpas från och med den 3 januari 2018. Artikel 18 ska emellertid börja tillämpas från och med dagen för denna förordnings ikraftträdande.

Denna förordning är till alla delar bindande och direkt tillämplig i alla medlemsstater.

▼M3

BILAGA I

Beskrivning av typen av system och den information som ska offentliggöras i enlighet med artikel 2

Typ av system	Systembeskrivning	Information som ska offentliggöras
Handelssystem med orderbok i form av löpande auktioner	Ett system som med hjälp av en orderbok och en handelsalgoritm utan mänskligt ingripande fortlöpande matchar säljorder mot köporder utifrån bästa tillgängliga pris.	För varje finansiellt instrument, det sammanlagda antalet order och den volym de motsvarar på varje prisnivå för åtminstone de fem bästa köp- och säljkursnivåerna.
Budbaserat handelssystem	Ett system där transaktionerna genomförs på grundval av fasta bud som fortlöpande tillhandahålls deltagarna, vilket kräver att storleken på marknads-garanternas bud balanserar marknads-garantens risk och medlemmarnas eller deltagarnas behov av att handla på en affärsmässig budnivå.	För varje finansiellt instrument, den bästa köp- och säljkursen för varje marknads-garant i det instrumentet, tillsammans med de volymer som sammanhänger med dessa kurser. De bud som offentliggörs ska vara de som utgör bindande åtaganden att köpa och sälja de finansiella instrumenten och som anger kurs och volym för finansiella instrument till vilka registrerade marknads-garanter är villiga att köpa eller sälja. När exceptionella marknads-villkor råder, kan det under begränsad tid tillåtas att man bara ger ett köp- eller säljbud eller anger vägledande priser.
Handelssystem med periodiskt återkommande auktioner	Ett system som matchar order genom periodiskt återkommande auktioner och en automatisk handelsalgoritm.	För varje finansiellt instrument, den kurs vid vilken auktionshandelssystemet bäst skulle tillfredsställa sin handelsalgoritm och den volym som potentiellt skulle kunna genomföras vid den kursen av deltagare i det systemet.
RFQ-handelssystem	Ett handelssystem i vilket bud lämnas till följd av en anbudsfrågan från en eller flera andra medlemmar eller aktörer. Budet är endast verkställbart av den medlem eller aktör som lämnat anbudsfrågan. Den medlem eller marknads-aktör som lämnat anbudsfrågan får genomföra en transaktion genom att godkänna det eller de bud som inkommit på deras begäran.	De bud och tillhörande volymer från en medlem eller marknadsaktör som, om de godtas, skulle medföra en transaktion enligt systemets regler. Alla bud som inlämnats som svar på en anbudsfrågan får offentliggöras samtidigt, dock senast när de blir genomförbara.
Röstbaserat handelssystem	Ett handelssystem där transaktioner mellan medlemmar ingås genom röstbaserad förhandling.	De köp- och säljkurser med tillhörande volymer från en medlem eller marknadsaktör som, om de godtas, skulle medföra en transaktion enligt systemets regler.

▼ **M3**

Typ av system	Systembeskrivning	Information som ska offentliggöras
Handelssystem av hybridtyp	Ett system som överensstämmer med två eller flera av de typer av handelssystem som anges i raderna 1–5 i denna tabell.	För de handelssystem av hybridtyp som kombinerar olika handelssystem samtidigt motsvarar kraven de krav på transparens före handel som gäller för varje typ av handelssystem som ingår i hybridsystemet. För hybridhandelssystem som kombinerar två eller flera handelssystem efter varandra motsvarar kraven de krav på transparens före handel som gäller för respektive handelssystem som drivs vid en viss tidpunkt.
Varje annat handelssystem	Varje annan typ av handelssystem som inte omfattas av raderna 1–6.	Tillräcklig information vad gäller det finansiella instrumentets orderdjup eller kurs samt intresset för handel med det finansiella instrumentet, särskilt de fem bästa köp- och säljbuden och/eller varje marknadsgarants fem bästa köp- och säljbud för det finansiella instrumentet ska offentliggöras, om prisbildningsmekanismens egenskaper så tillåter.

▼ **B**

BILAGA II

Närmare uppgifter om transaktioner som ska offentliggöras

Tabell 1

Symboltabell för tabell 2

SYMBOL	TYP AV UPPGIFT	DEFINITION
{ALPHANUM-n}	Upp till n alfanumeriska tecken	Fritextfält
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumeriska tecken	Valutakod med 3 bokstäver enligt ISO 4217 valutakoder
{DATE_TIME_FORMAT}	Datum- och tidsformat enligt ISO 8601	Datum och tid i följande format: ÅÅÅÅ-MM-DDThh:mm:ss.ddddZ. där — "ÅÅÅÅ" är året — "MM" är månaden — "DD" är dagen — "T" – innebär att bokstaven "T" ska användas — "hh" är timmen — "mm" är minuten — "ss.dddd" är sekunden och dess bråkdel — Z är UTC-tid Datum och tider ska rapporteras i UTC
{DECIMAL-n/m}	Decimaltal på upp till n siffror totalt, av vilka upp till m siffror kan vara bråkdelar	Numeriskt fält för både positiva och negativa värden: — decimaltecknet är "." (punkt) — negativa siffror föregås av "-" (minus) Om tillämpligt ska värden avrundas och trunkeras inte
{ISIN}	12 alfanumeriska tecken	ISIN-kod enligt ISO 6166
{MIC}	4 alfanumeriska tecken	Kod för marknadsidentifiering enligt ISO 10383

▼ **M3**

Tabell 2

Förteckning av detaljer för transparens efter handel

#	Identifikationsfält	Finansiella instrument	Beskrivning och närmare uppgifter som ska offentliggöras	Typ av genomförande eller offentliggörande	Format som ska ifyllas enligt tabell 1
1	Datum och tidpunkt för handeln	För alla finansiella instrument	Datum och tid för transaktionens genomförande	Reglerad marknad (RM)	{DATE_TIME_FORMAT}

▼ M3

#	Identifikationsfält	Finansiella instrument	Beskrivning och närmare uppgifter som ska offentliggöras	Typ av genomförande eller offentliggörande	Format som ska ifyllas enligt tabell 1
			<p>För transaktioner som utförs på en handelsplats ska detaljnivån överensstämja med de krav som anges i artikel 2 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574 (1).</p> <p>För transaktioner som inte genomförs på en handelsplats ska datum och tid vara när parterna enas om innehållet i följande fält: kvantitet, pris, valutor, såsom specificeras i fälten 31, 34 och 44 i tabell 2 i bilaga I till delegerade förordning (EU) 2017/590, instrumentets identifieringskod, instrumentklassificering och underliggande instrumentkod, där tillämpligt. För transaktioner som inte genomförs på en handelsplats ska rapporterad tid anges till åtminstone närmaste sekund</p> <p>Om transaktionen följer av en order från det utförande företaget på uppdrag av en kund till en tredje part där de villkor för överförande som anges i artikel 4 i delegerade förordning (EU) 2017/590 inte var uppfyllda, ska detta vara datumet och tidpunkten för transaktionen snarare än tidpunkten för orderöverföringen</p>	<p>Multilateral handelsplattform (MTF), Organiserad handelsplattform (OTF)</p> <p>Godkänt publiceringsarrangemang (APA)</p> <p>Tillhandahållare av konsoliderad handelsinformation (CTP)</p>	
2	Instrumentets identifieringskod	För alla finansiella instrument	Kod som används för att identifiera det finansiella instrumentet	RM, MTF, APA, CTP, CTF	{ISIN}.
3	Pris	För alla finansiella instrument	<p>Handlat pris för transaktionen exklusive, i de fall det är tillämpligt, provision och ackumulerad ränta</p> <p>Det handlade priset ska rapporteras i enlighet med standardkonventionen på marknaden. Det värde som anges i detta fält ska överensstämja med det värde som anges i fältet ”Prisnotering”.</p> <p>Om priset inte finns tillgängligt utan inväntas (”PNDG”) eller inte är tillämpligt (”NOAP”), ska detta fält inte fyllas i.</p>	RM, MTF, APA, CTF, CTP	<p>{DECIMAL-18/13} om priset är uttryckt som monetärt värde</p> <p>{DECIMAL-11/10} om priset är uttryckt som procentandel eller avkastning</p> <p>{DECIMAL-18/17} om priset är uttryckt som baspunkter</p>

▼ M3

#	Identifikationsfält	Finansiella instrument	Beskrivning och närmare uppgifter som ska offentliggöras	Typ av genomförande eller offentliggörande	Format som ska ifyllas enligt tabell 1
4	Pris saknas	För alla finansiella instrument	Om priset inte finns tillgängligt utan inväntas ska värdet vara "PNDG". Om priset inte är tillämpligt ska värdet vara "NOAP".	RM, MTF, APA, CTP	"PNDG" om priset inte är tillgängligt "NOAP" om priset inte är tillämpligt
5	Prisvaluta	För alla finansiella instrument	Huvudvalutan i vilken priset är uttryckt (tillämpligt om priset är uttryckt som ett monetärt värde).	RM, MTF, APA, CTP	{CURRENCY-CODE_3}
6	Prisnotering	För alla finansiella instrument	Angivelse om huruvida priset är uttryckt som monetärt värde, baspunkter, procentandel eller i avkastning Prisnoteringen ska rapporteras i enlighet med standardkonventionen på marknaden. För kreditswappar ska "BAPO" anges i fältet. För obligationer (andra än ETN:er och ETC:er) ska detta fält fyllas i med procentandel (PERC) av det teoretiska beloppet. Om ett pris i procent inte är standardkonvention på marknaden ska det fyllas i med YIEL, BAPO eller MONE, i enlighet med standardkonventionen på marknaden. Information som rapporteras i detta fält ska överensstämja med det värde som anges i fältet "Pris". När priset rapporteras i monetära termer ska det anges i den större valutaenheten. Om priset inte finns tillgängligt utan inväntas ("PNDG") eller inte är tillämpligt ("NOAP"), ska detta fält inte fyllas i.	RM, MTF, APA, CTP	"MONE" – Monetärt värde "PERC" – Procentandel "YIEL" – Avkastning "BAPO" – Baspunkter
7	Kvantitet	För alla finansiella instrument utom de fall som beskrivs i artikel 11.1 a och b i denna förordning.	För finansiella instrument som handlas i enheter, antal enheter av det finansiella instrumentet. Annars tom.	RM, MTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/17}

▼ M3

#	Identifikationsfält	Finansiella instrument	Beskrivning och närmare uppgifter som ska offentliggöras	Typ av genomförande eller offentliggörande	Format som ska ifyllas enligt tabell 1
8	Kvantitet i måttenhet	För kontrakt angivna i enheter i råvaruderivat, C10-derivat, utsläppsderivat och utsläppsrätter utom de fall som beskrivs i artikel 11.1 a och b i denna förordning.	Motsvarande mängd av råvaror eller utsläppsrätter som handlas uttryckt i måttenhet.	RM, OTF, CTP	MTF, APA, {DECIMAL-18/17}
9	Notering av kvantiteten i måttenhet	För kontrakt angivna i enheter i råvaruderivat, C10-derivat, utsläppsderivat och utsläppsrätter utom de fall som beskrivs i artikel 11.1 a och b i denna förordning	Angivelse av noteringen i vilken kvantiteten i måttenhet uttrycks	RM, OTF, CTP	MTF, APA, "TOCD" – ton koldioxidekvivalenter, för alla kontrakt som avser utsläppsrätter "TONE" – ton "MWHO" – megawattimmar "MBTU" – en miljon Btu (<i>British thermal units</i>) "THMS" – villkor "DAYS" – dagar eller {ALPHANUM-4} i annat fall
10	Teoretiskt belopp	För alla finansiella instrument utom de fall som beskrivs i artikel 11.1 a och b i denna förordning.	I detta fält ska följande anges: (i) För obligationer (exklusive ETC:er och ETN:er) ska det nominella värdet anges, vilket är det belopp som återbetalas vid inlösen till investeraren.	RM, OTF, CTP	MTF, APA, {DECIMAL-18/5}

▼ M3

#	Identifikationsfält	Finansiella instrument	Beskrivning och närmare uppgifter som ska offentliggöras	Typ av genomförande eller offentliggörande	Format som ska ifyllas enligt tabell 1
			<p>ii) För ETC:er, ETN:er och värdepapperiserade derivat ska antalet instrument som utbyts mellan köparna och säljarna multiplicerat med priset på det instrument som utbyts för den specifika transaktionen anges. På motsvarande sätt prisfältet multiplicerat med kvantitetsfältet.</p> <p>iii) För strukturerade finansiella produkter (SFP:er) ska det nominella värdet per enhet multiplicerat med antalet instrument vid tidpunkten för transaktionen anges.</p> <p>iv) För kreditswappar ska det teoretiska belopp för vilket skyddet förvärvas eller avyttras anges.</p> <p>v) För optioner, swaptioner, andra swappar än de som anges i iv, futures och forwards ska kontraktets teoretiska belopp anges.</p> <p>vi) För utsläppsrätter ska det resulterande beloppet för kvantiteten till det relevanta pris som fastställts i kontraktet vid tidpunkten för transaktionen anges. På motsvarande sätt prisfältet multiplicerat med kvantiteten i fältet måttenhet.</p> <p>vii) För spread betting ska det monetära värde som satsats per punktförändring i det underliggande finansiella instrumentet anges.</p>		

▼ M3

#	Identifikationsfält	Finansiella instrument	Beskrivning och närmare uppgifter som ska offentliggöras	Typ av genomförande eller offentliggörande	Format som ska ifyllas enligt tabell 1
			viii) För differenskontrakt ska antalet instrument som utbyts mellan köparna och säljarna multiplicerat med priset på det instrument som utbyts för den specifika transaktionen anges. På motsvarande sätt priset multiplicerat med kvantitetsfältet.		
11	Teoretisk valuta	För alla finansiella instrument utom de fall som beskrivs i artikel 11.1 a och b i denna förordning.	Huvudvaluta som det teoretiska beloppet är denominerat i. Om det rör sig om ett valutaderivatkontrakt, en valutaswap vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (<i>multi-currency swap</i>) eller swaption där den underliggande swappen är en multi-currency swap eller ett valuta-CFD- eller spread betting-kontrakt, ska det vara den teoretiska valutan för del 1.	RM, MTF, APA, CTP	{CURRENCY-CODE_3}
12	Typ	Endast för utsläppsrätter och utsläppsrätsderivat	Detta fält är endast tillämpligt på utsläppsrätter och utsläppsrätsderivat	RM, MTF, APA, CTP	”EUAE” – EUA ”CERE” – CER ”ERUE” – ERU ”EUAA” – EUAA ”OTHR” – Övrigt
13	Handelsplats	För alla finansiella instrument	Identifiering av den plats där transaktionen utfördes Använd ISO 10383 MIC-segmentet för transaktioner som utförs på en handelsplats i EU. Om segmentet MIC inte finns, använd operativ MIC	RM, MTF, APA, CTP	{MIC} – handelsplatser i EU eller ”SINT” – systematisk internhandlare ”XOFF” – annars

▼ M3

#	Identifikationsfält	Finansiella instrument	Beskrivning och närmare uppgifter som ska offentliggöras	Typ av genomförande eller offentliggörande	Format som ska ifyllas enligt tabell 1
			<p>Använd "SINT" för finansiella instrument som tas upp till handel eller som lämnas in av en handelsplats, om transaktionen med det finansiella instrumentet genomförs av en systematisk internhandlare</p> <p>Använd MIC eller "XOFF" för finansiella instrument som tas upp till handel eller som lämnas in av en handelsplats, om transaktionen med det finansiella instrumentet varken utförs på en handelsplats i EU eller genomförs av en systematisk internhandlare. Om transaktionen utförs på en organiserad handelsplattform utanför EU, krävs utöver "XOFF" att fältet "Handelsplats för utförande i tredje land" fylls i.</p>		
14	Handelsplats för utförande i tredjeland	För alla finansiella instrument	<p>Identifiering av den handelsplats i tredjeland där transaktionen utfördes.</p> <p>Använd ISO 10383 MIC-segmentet Om segmentet MIC inte finns, använd operativ MIC</p> <p>För transaktioner som inte genomförs på en handelsplats i tredjeland ska fältet inte fyllas i.</p>	APA, CTP	{MIC}
15	Datum och tidpunkt för offentliggörandet	För alla finansiella instrument	<p>Datum och tidpunkt för offentliggörande av transaktionen av en handelsplats eller APA</p> <p>För transaktioner som utförs på en handelsplats ska detaljnivån överensstämja med de krav som anges i artikel 2 i delegerade förordning (EU) 2017/574</p> <p>För transaktioner som inte genomförs på en handelsplats ska rapporterad tidpunkt anges till åtminstone närmaste sekund</p>	RM, OTF, CTP, MTF, APA,	{DATE_TIME_FORMAT}

▼ M3

#	Identifikationsfält	Finansiella instrument	Beskrivning och närmare uppgifter som ska offentliggöras	Typ av genomförande eller offentliggörande	Format som ska ifyllas enligt tabell 1
16	Plats för offentliggörande	För alla finansiella instrument	Kod som används för att identifiera handelsplatsen och APA som offentliggör transaktionen	CTP	Handelsplats: {MIC} APA: MIC där sådana finns. I övrigt, fyrsiffrig kod enligt förteckning över leverantörer av data-rapporteringstjänster på Esmas webbplats
17	Transaktionsidentifieringskod	För alla finansiella instrument	Alfanumeriska koder som tilldelats av handelsplatser (enligt artikel 12 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/580 ⁽²⁾) och APA och som används i efterföljande referenser till den specifika handeln. Identifikationskoden för transaktioner ska vara unik, konsekvent och bestående per ISO 10383 MIC för segment och per handelsdag. Om handelsplatsen inte använder MIC för segment ska identifikationskoden för transaktioner vara unik, konsekvent och bestående per operativ MIC per handelsdag Om APA inte använder MIC ska den vara unik, konsekvent och bestående per fyrställig kod för att identifiera APA per handelsdag Komponenterna i identifikationskoden ska inte visa identiteten av motparterna i de transaktioner som koden upprätthålls för	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{ALPHANUMERICAL-52}
18	Transaktion som ska clearas	För derivat	Kod för att fastställa huruvida transaktionen kommer att clearas	RM, MTF, OTF, APA, CTP	”TRUE” – transaktion som ska clearas ”FALSE” – transaktion som inte ska clearas

(1) a) Kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/574 av den 7 juni 2016 om komplettering av Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU avseende tekniska standarder för tillsyn när det gäller noggrannhetsnivån för klockor (EUT L 87, 31.3.2017, s. 148).

(2) Kommissionens delegerade förordning (EU) 2017/580 av den 24 juni 2016 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 600/2014 avseende tekniska standarder för tillsyn när det gäller bevarande av relevanta uppgifter om order som avser finansiella instrument (EUT L 87, 31.3.2017, s. 193).
Delegerad förordning (EU) nr 148/2013 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 om OTC-derivat, centrala motparter och transaktionsregister med avseende på tekniska genomförandestandarder för minimikrav på de uppgifter som ska rapporteras till transaktionsregister.

▼ M3

Tabell 3

Förteckning över flaggor för transparens efter handel

Flagga	Namn	Typ av genomförande eller offentliggörande	Beskrivning
”BENC”	Flagga för referenstransaktion	RM, MTF, OTF, APA, CTP	Transaktioner som utförs med hänvisning till ett pris som beräknas över flera tidpunkter enligt ett givet referensvärde, t.ex. handelsviktat genomsnittspris eller tidsviktat genomsnittspris.
”ACTX”	Flagga för korsvis transaktion genom ombud	APA, CTP	Transaktioner där ett värdepappersföretag sammanför två kundorder och köp och försäljning utförs som en enda transaktion med samma volym och pris
”NPFT”	Flagga för icke prisbildande transaktion	RM, MTF, OTF, CTP	Icke prisbildande transaktion som anges i artikel 2.5 i delegerad förordning (EU) 2017/590.
”LRGS”	Flagga för transaktion av omfattande storlek efter handel	RM, MTF, OTF, APA, CTP	Efter handel undantag för transaktioner större än normalt på marknaden
”ILQD”	Flagga för transaktion med illikvida instrument	RM, MTF, OTF, APA, CTP	Transaktioner som utförs enligt uppskovet för instrument för vilka det saknas en likvid marknad
”SIZE”	Flagga för SSTI-transaktion efter handel	RM, MTF, OTF, APA, CTP	Efter handel undantag för transaktioner som överstiger en storlek som är specifik för instrumentet
”TPAC”	Flagga för pakettransaktion	RM, MTF, OTF, APA, CTP	Pakettransaktioner som inte är utbyte mot fysisk tillgång (EFP) enligt definition i artikel 1
”XFPH”	Flagga för utbyte mot fysisk tillgång (EFP)	RM, MTF, OTF, APA, CTP	Utbyte mot fysisk tillgång (EFP) enligt definition i artikel 1.
”CANC”	Flagga för annullering	RM, MTF, APA, CTP	När en tidigare offentliggjord transaktion annulleras
”AMND”	Flagga för ändring	RM, MTF, APA, CTP	När en tidigare offentliggjord transaktion ändras
”PORT”	Flagga för portföljhandel	RM, MTF, APA, CTP	Transaktion i fem eller flera olika finansiella instrument där dessa transaktioner handlas samtidigt av samma kund och mot ett enda delpris och som inte är en ”pakettransaktion” i den mening som avses i artikel 1.1.

▼ M3

YTTERLIGARE FLAGGOR FÖR UPPSKJUTANDE

Artikel 11.1 a i	”LMTF”	Flagga för begränsade uppgifter	RM, MTF, OTF APA CTP	Första rapport med offentliggörande av begränsade uppgifter i enlighet med artikel 11.1 a i.
	”FULF”	Flagga för fullständiga uppgifter		Transaktion för vilken begränsade uppgifter har offentliggjorts tidigare i enlighet med artikel 11.1 a i
Artikel 11.1 a ii	”DATF”	Flagga för daglig aggregerad transaktion	RM, MTF, OTF APA CTP	Offentliggörande av daglig aggregerad transaktion i enlighet med artikel 11.1 a ii.
	”FULA”	Flagga för fullständiga uppgifter	RM, MTF, OTF APA CTP	Enskilda transaktioner för vilka aggregerade uppgifter har offentliggjorts tidigare i enlighet med artikel 11.1 a ii.
Artikel 11.1 b	”VOLO”	Flagga för icke offentliggjord volym	RM, MTF, OTF APA CTP	Transaktion för vilken begränsade uppgifter offentliggörs i enlighet med artikel 11.1 b.
	”FULV”	Flagga för fullständiga uppgifter	RM, MTF, OTF APA CTP	Transaktion för vilken begränsade uppgifter har offentliggjorts tidigare i enlighet med artikel 11.1 b
Artikel 11.1 c	”FWAF”	Flagga för fyra veckors aggregering	RM, MTF, OTF APA CTP	Offentliggörande av aggregerade transaktioner i enlighet med artikel 11.1 c.
	”FULJ”	Flagga för fullständiga uppgifter	RM, MTF, OTF APA CTP	Enskilda transaktioner som tidigare har offentliggjorts i aggregerad form i enlighet med artikel 11.1 c.
Artikel 11.1 d	”IDAF”	Flagga för evig aggregering	RM, MTF, OTF APA CTP	Transaktioner för vilka offentliggörandet av flera transaktioner i aggregerad form för en obestämd tidsperiod är tillåten i enlighet med artikel 11.1 d.
Upprepad användning av artikel 11.1 b och artikel 11.2 c för statspapper	”VOLW”	Flagga för icke offentliggjord volym	RM, MTF, OTF APA CTP	Transaktion för vilken begränsade uppgifter offentliggörs i enlighet med artikel 11.1 b och för vilken offentliggörande av flera transaktioner i aggregerad form för en obestämd tidsperiod kommer att tillåtas i följd i enlighet med artikel 11.2 c.

▼ **M3**

	”COAF”	Flagga för aggregering i följd (efter icke offentliggörande av volym för statspapper)	RM, MTF, OTF APA CTP	Transaktion för vilken begränsade uppgifter har offentliggjorts tidigare i enlighet med artikel 11.1 b och för vilken offentliggörande av flera transaktioner i aggregerad form för en obestämd tidsperiod har tillåtits i följd i enlighet med artikel 11.2 c.
--	--------	---	-------------------------	---

Tabell 4

Volymmått

Typ av instrument	Volym
Alla obligationer utom börshandlade certifikat (ETC och ETN) och strukturerade finansiella produkter	”Teoretiskt belopp” för det handlade kontraktet enligt fält 10 i tabell 2 i bilaga II till denna förordning.
Obligationer av typen ETC och ETN	”Teoretiskt belopp” för det handlade kontraktet enligt fält 10 i tabell 2 i bilaga II till denna förordning.
Värdepapperiserade derivat	”Teoretiskt belopp” för det handlade kontraktet enligt fält 10 i tabell 2 i bilaga II till denna förordning.
Räntederivat	”Teoretiskt belopp” för det handlade kontraktet enligt fält 10 i tabell 2 i bilaga II till denna förordning.
Valutaderivat	”Teoretiskt belopp” för det handlade kontraktet enligt fält 10 i tabell 2 i bilaga II till denna förordning.
Aktiederivat	”Teoretiskt belopp” för det handlade kontraktet enligt fält 10 i tabell 2 i bilaga II till denna förordning.
Råvaruderivat	”Teoretiskt belopp” för det handlade kontraktet enligt fält 10 i tabell 2 i bilaga II till denna förordning.
Kreditderivat	”Teoretiskt belopp” för det handlade kontraktet enligt fält 10 i tabell 2 i bilaga II till denna förordning.
CFD-kontrakt	”Teoretiskt belopp” för det handlade kontraktet enligt fält 10 i tabell 2 i bilaga II till denna förordning.
C10-derivat	”Teoretiskt belopp” för det handlade kontraktet enligt fält 10 i tabell 2 i bilaga II till denna förordning.
Utsläppsrechtsderivat	”Kvantitet i måttenhet” enligt fält 8 i tabell 2 i bilaga II till denna förordning.
Utsläppsätter	”Kvantitet i måttenhet” enligt fält 8 i tabell 2 i bilaga II till denna förordning.

*BILAGA III***Likviditetsbedömning, tröskelvärden avseende storlek för icke-aktierelaterade finansiella instrument****1. Instruktioner för denna bilaga**

1. Med *tillgångsklass* avses följande klasser av finansiella instrument: obligationer, strukturerade finansiella produkter, värdepapperiserade derivat, räntederivat, aktiederivat, råvaruderivat, valutaderivat, kreditderivat, C 10-derivat, CFD-kontrakt, utsläppsrätter och utsläppsrättsderivat.

2. Med en *underklass av tillgångar* avses en tillgångsklass som är uppdelad på en mer detaljerad nivå på grundval av en kontraktstyp och/eller typen av underliggande.

3. Med *underklass* avses en underklass av tillgångar som är uppdelad på en mer detaljerad nivå på grundval av ytterligare kvalitativa kriterier för segmentering som anges i tabellerna 2.1–13.3 i denna bilaga.

4. *Genomsnittlig daglig omsättning*: den totala omsättningen för ett visst finansiellt instrument som fastställs enligt volymmåttet som anges i tabell 4 i bilaga II och som utförts under den period som anges i artikel 13.7, delat med antalet handelsdagar under den perioden eller, där tillämpligt, den del av året under vilken det finansiella instrumentet upptogs för handel eller handlades på en handelsplats och inte undandrogs från handel.

5. *Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp*: det totala teoretiska beloppet för ett visst finansiellt instrument som fastställs enligt volymmåttet som anges i tabell 4 i bilaga II och som utförts under den period som anges i artikel 13.18 för alla obligationer utom ETC och ETN och i artikel 13.7 för övriga finansiella instrument, delat med antalet handelsdagar under den perioden eller, där tillämpligt, den del av året under vilken det finansiella instrumentet upptogs för handel eller handlades på en handelsplats och inte undandrogs från handel.

6. *Procentandel dagar som handlas under den berörda perioden*: antalet dagar i den period som anges i artikel 13.18 för alla obligationer utom ETC och ETN och i artikel 13.7 för strukturerade finansiella produkter, på vilka åtminstone en transaktion har utförts för det finansiella instrumentet, delat med antalet handelsdagar under den perioden eller, där tillämpligt, den del av året under vilken det finansiella instrumentet upptogs för handel eller handlades på en handelsplats och inte undandrogs från handel.

7. *Genomsnittligt dagligt antal transaktioner*: det totala antalet transaktioner som utförs för ett visst finansiellt instrument under den period som anges i artikel 13.18 för alla obligationer utom ETC och ETN och i artikel 13.7 för övriga finansiella instrument, delat med antalet handelsdagar under den perioden eller, där tillämpligt, den del av året under vilken det finansiella instrumentet upptogs för handel eller handlades på en handelsplats och inte undandrogs från handel.

▼ B

8. *Future*: ett kontrakt för att köpa eller sälja en råvara eller ett finansiellt instrument vid ett angivet framtida datum till ett pris som överenskommits vid kontraktets ingående av köparen och säljaren. Varje futurekontrakt har standardvillkor som anger minsta och högsta kvantitet och kvalitet som kan köpas eller säljas, minsta prisvariation, leveransvillkor, löptid och andra egenskaper som rör kontraktet.
9. *Option*: ett kontrakt som ger ägaren rätten men inte skyldigheten att köpa (call) eller sälja (put) ett visst finansiellt instrument eller en råvara till ett förutbestämt pris, ”strike-pris” eller lösenpris, på eller fram till dagen för avslutandet av kontraktet.
10. *Swap*: ett kontrakt i vilket två parter kommer överens om att utbyta kassaflöden i ett finansiellt instrument mot ett annat vid ett visst framtida datum.
11. *Portföljswap*: ett kontrakt genom vilket slutanvändare kan utbyta flera swappar.
12. *Forwardkontrakt*: ett privat kontrakt mellan två parter för att köpa eller sälja en råvara eller ett finansiellt instrument vid ett angivet framtida datum till ett pris som överenskommits vid kontraktets ingående av köparen och säljaren.

▼ M3

13. *swaption* eller *option på en swap*: ett kontrakt som ger ägaren rätten, men inte skyldigheten, att ingå en swap på eller fram till ett framtida datum eller fram till dagen för avslutandet av kontraktet.

▼ B

14. *Terminskontrakt på swap*: ett terminskontrakt som ger ägaren skyldigheten att ingå en swap på eller fram till dagen för avslutandet av kontraktet.
15. *Terminskontrakt på swap*: ett terminskontrakt som ger ägaren skyldigheten att ingå en swap på eller vid ett visst framtida datum.

2. Obligationer

Tabell 2.1

Obligationer (alla typer av obligationer utom ETC och ETN) – klasser som saknar en likvid marknad

Tillgångsklass – Obligationer (alla typer av obligationer utom ETC och ETN)					
Det ska anses att varje enskilt finansiellt instrument inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier på kumulativ basis.					
Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]				Procentandel handelsdagar under den berörda perioden [kvantitativt likviditetskriterium 3]
EUR 100 000	S1	S2	S3	S4	80 %
	15	10	7	2	

Tabell 2.2

Obligationer (alla typer av obligationer utom ETC och ETN) – klasser som saknar en likvid marknad

Tillgångsklass – Obligationer (alla typer av obligationer utom ETC och ETN)			
Det ska anses att varje enskild obligation inte har en likvid marknad enligt artikel 13.18 om den kännetecknas av en specifik kombination av obligationstyper och emissionsstorlek som anges i varje rad i tabellen.			
Typ av obligation		Emissionsstorlek – RTS23#14	
Statsobligation RTS2#3 = BOND och RTS2#9 = EUSB	en obligation som varken är en konvertibel eller en säkerställd obligation och som emitteras av en statlig emittent: a) Unionen. b) En medlemsstat, inbegripet förvaltningar, organ eller specialföretag i medlemsstaten. c) En suverän enhet som inte är upptagen i leden a och b.	mindre än (EUR)	1 000 000 000
Annan offentlig obligation RTS2#3 = BOND och RTS2#9 = OEPB	är en obligation som varken är en konvertibel eller en säkerställd obligation och som emitteras av någon av följande offentliga emittenter: a) när det gäller en federal medlemsstat, en delstat i den federationen, b) ett specialföretag för flera medlemsstater, c) en internationell finansinstitution som etablerats av minst två medlemsstater och vars mål är att uppbåda finansiering och tillhandahålla finansiellt bistånd till de medlemmar som har eller riskerar att få allvarliga finansieringsproblem, d) Europeiska investeringsbanken, e) ett offentligt organ som inte är en utfärdare av statsobligationer som anges i den föregående raden.	mindre än (EUR)	500 000 000

▼ M3

Tillgångsklass – Obligationer (alla typer av obligationer utom ETC och ETN)			
Typ av obligation		Emissionsstorlek – RTS23#14	
Konvertibel obligation RTS2#3 = BOND och RTS2#9 = CVTB	är ett instrument som består av en obligation eller ett säkerställt skuldinstrument med inbäddat derivat, till exempel en köption för det underliggande värdepapiret	mindre än (EUR) 500 000 000	
Säkerställda obligationer RTS2#3 = BOND och RTS2#9 = CVDB	är de obligationer som avses i artikel 52.4 i direktiv 2009/65/EG	under stegen S1 och S2	
		mindre än (EUR) 1 000 000 000	mindre än (EUR) 500 000 000
Företagsobligation RTS2#3 = BOND och RTS2#9 = CRPB	är en obligation som varken är en konvertibel eller en säkerställd obligation och som utfärdas av ett SE-bolag som inrättats i enlighet med förordning (EG) nr 2157/2001 ⁽¹⁾ eller en typ av företag som förtecknas i bilaga I eller bilaga II till Europaparlamentets och rådets direktiv 2013/34/EU ⁽²⁾ eller motsvarande i tredjeländer	under stegen S1 och S2	
		mindre än (EUR) 1 000 000 000	mindre än (EUR) 500 000 000
Typ av obligation	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artikel 13.18 ska följande metod tillämpas		
Annan obligation RTS2#3 = BOND och RTS2#9 = OTHR	En obligation som inte tillhör någon av ovanstående obligationstyper anses inte ha en likvid marknad		

⁽¹⁾ Rådets förordning (EG) nr 2157/2001 av den 8 oktober 2001 om stadga för europabolag (EUT L 294, 10.11.2001, s. 1).

⁽²⁾ Europaparlamentets och rådets direktiv 2013/34/EU av den 26 juni 2013 om årsbokslut, koncernredovisning och rapporter i vissa typer av företag, om ändring av Europaparlamentets och rådets direktiv 2006/43/EG och om upphävande av rådets direktiv 78/660/EEG och 83/349/EEG, EUT L 182, 29.6.2013, s. 19.

Tabell 2.3

Obligationer (alla typer av obligationer utom ETC och ETN) – SSTI och LIS-tröskelvärden före och efter handel

Tillgångsklass – Obligationer (alla typer av obligationer utom ETC och ETN)										
Typ av obligation	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden per obligationstyp	Percentiler som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för varje obligationstyp								
		SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel	LIS efter handel	
		Handel – percentil		Lägsta tröskelvärde		Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Handel – percentil	
Statsobligation	transaktioner som utförs för statsobligationer efter uteslutande av transaktioner som anges i artikel 13.10	S1	S2	S3	S4	EUR 300 000	70	EUR 300 000	80	90
		30	40	50	60					
Annan offentlig obligation	transaktioner som utförs för andra statsobligationer efter uteslutande av transaktioner som anges i artikel 13.10	S1	S2	S3	S4	EUR 300 000	70	EUR 300 000	80	90
		30	40	50	60					
Konvertibel obligation	transaktioner som utförs för konvertibla obligationer efter uteslutande av transaktioner som anges i artikel 13.10	S1	S2	S3	S4	EUR 200 000	70	EUR 200 000	80	90
		30	40	50	60					
Säkerställda obligationer	transaktioner som utförs för säkerställda obligationer efter uteslutande av transaktioner som anges i artikel 13.10	S1	S2	S3	S4	EUR 300 000	70	EUR 300 000	80	90
		30	40	40	40					
Företagsobligation	transaktioner som utförs för företagsobligationer efter uteslutande av transaktioner som anges i artikel 13.10	S1	S2	S3	S4	EUR 200 000	70	EUR 200 000	80	90
		30	40	50	60					
Andra obligationer	transaktioner som utförs för andra obligationer efter uteslutande av transaktioner som anges i artikel 13.10	S1	S2	S3	S4	EUR 200 000	70	EUR 200 000	80	90
		30	40	50	60					

▼ M3

Tabell 2.4

Obligationer (ETC och ETN) – klasser som saknar en likvid marknad

Typ av obligation	Det ska anses att varje enskilt finansiellt instrument som inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier	
	Genomsnittlig daglig omsättning (ADT) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
Börshandlade råvaror (ETC:er) - RTS2#3 = ETCS ett skuldinstrument som utfärdas mot en direktinvestering av utfärdaren av råvaror eller kontrakt för råvaruderivat. Priset för en ETC är direkt eller indirekt knutet till det underliggandes resultat. En ETC följer passivt utvecklingen hos den råvara eller de råvaruindex som den avser.	EUR 500 000	10
Börshandlade skuldförbindelser (ETN:er) - RTS2#3 = ETNS ett skuldinstrument som utfärdas mot en direktinvestering av utfärdaren av råvaror eller kontrakt för råvaruderivat. Priset för en ETN är direkt eller indirekt knutet till det underliggandes resultat. En ETC följer passivt utvecklingen hos den underliggande som den avser.	EUR 500 000	10

▼ B

Tabell 2.5

Obligationer (ETC och ETN) – SSTI och LIS-tröskelvärden före och efter handel

Tillgångsklass – Obligationer (ETC och ETN)				
SSTI och LIS-tröskelvärden för transparens före och efter handel för varje enskilt instrument som anses ha en likvid marknad				
Typ av obligation	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
ETC	EUR 1 000 000	EUR 1 000 000	EUR 50 000 000	EUR 50 000 000
ETN	EUR 1 000 000	EUR 1 000 000	EUR 50 000 000	EUR 50 000 000

▼B

Tillgångsklass – Obligationer (ETC och ETN)				
Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för varje enskilt instrument som inte anses ha en likvid marknad				
Typ av obligation	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
ETC	EUR 900 000	EUR 900 000	EUR 45 000 000	EUR 45 000 000
ETN	EUR 900 000	EUR 900 000	EUR 45 000 000	EUR 45 000 000

3. Strukturerade finansiella produkter (SFP)

▼M3

Tabell 3.1

SFP – klasser som inte har en likvid marknad

Tillgångsklass – Strukturerade finansiella produkter (SFP:er)		
Test 1 – bedömning av tillgångsklass SFP		
Bedömning av tillgångsklass SFP för att fastställa finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b – RTS2#3 = SFPS		
Transaktioner som ska beaktas för beräkning av de värden som rör kvantitativa likviditetskriterier för bedömning av tillgångsklass SFP	Tillgångsklassen SFP ska bedömas genom tillämpning av följande tröskelvärden för de kvantitativa likviditetskriterierna	
	Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
Transaktioner utförda i alla SFP	EUR 300 000 000	500
Test 2 – SFP som inte har en likvid marknad		
Om de värden som rör de kvantitativa likviditetskriterierna båda överstiger de kvantitativa likviditetströsklarna som fastställts för bedömningen av tillgångsklass SFP, är Test 1 godkänt och Test 2 ska utföras. Det ska anses att varje enskilt finansiellt instrument som inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier		
Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Procentandel handelsdagar under den berörda perioden [kvantitativt likviditetskriterium 3]
EUR 100 000	2	80 %

Tabell 3.2

SFP – SSTI och LIS-tröskelvärden före och efter handel om Test 1 inte är godkänt

Tillgångsklass – Strukturerade finansiella produkter (SFP)			
SSTI och LIS-tröskelvärden före och efter handel för alla SFP om Test 1 inte är godkänt			
SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
EUR 100 000	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 1 000 000

Tabell 3.3

SFP – SSTI och LIS-tröskelvärden före och efter handel om Test 1 är godkänt

Tillgångsklass – Strukturerade finansiella produkter (SFP)											
Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för underklasser som anses ha en likvid marknad om Test 1 är godkänt										
	SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel		LIS efter handel		
	Handel – percentil		Lägsta tröskel-värde		Handel – percentil	Lägsta tröskel-värde	Handel – percentil	Lägsta tröskel-värde	Handel – percentil	Lägsta tröskel-värde	
Transaktioner utförda i alla SF som anses ha en likvid marknad	S1	S2	S3	S4	EUR 100 000	70	EUR 250 000	80	EUR 500 000	90	EUR 1 000 000
	30	40	50	60							

SSTI och LIS tröskelvärden före och efter handel som inte anses ha en likvid marknad om Test 1 är godkänt			
SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
EUR 100 000	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 1 000 000

▼ B

4. Värdepapperiserade derivat

▼ M3

Tabell 4.1

Värdepapperiserade derivat – klasser som inte har en likvid marknad

Tillgångsklass – Värdepapperiserade derivat

är ett överförbart värdepapper enligt definition i artikel 4.1.44 c i direktiv 2014/65/EU som skiljer sig från strukturerade finansiella produkter och ska omfatta åtminstone

- a.1) vanliga täckta köpoptioner är värdepapper utfärdade av ett finansinstitut som ger innehavaren rätten, men inte skyldigheten, att
 - a) förvärva, senast på förfalldagen, en viss andel av den underliggande tillgången till ett förutbestämt pris, ”strike-pris” eller, om en överenskommelse om kontant betalning har gjorts, erhålla den positiva differensen mellan rådande marknadspris och strike-pris från säljaren, eller
 - b) sälja, senast på förfalldagen, en viss andel av den underliggande tillgången till ett förutbestämt strike-pris eller, om en överenskommelse om kontant betalning har gjorts, erhålla den positiva differensen mellan strike-pris och rådande marknadspris från köparen,
- a.2) köpoptioner som är värdepapper som emitterats av samma emittent av den underliggande tillgången och som ger innehavaren rätt, men inte skyldighet, att
 - a) förvärva, senast på förfalldagen, en viss andel av den underliggande tillgången till ett förutbestämt strike-pris eller, om en överenskommelse om kontant betalning har gjorts, erhålla den positiva differensen mellan rådande marknadspris och strike-pris från säljaren, eller
 - b) sälja, senast på förfalldagen, en viss andel av den underliggande tillgången till ett förutbestämt strike-pris eller, om en överenskommelse om kontant betalning har gjorts, erhålla den positiva differensen mellan strike-pris och rådande marknadspris från köparen,
- b) leverage certifikat är certifikat som följer resultaten för den underliggande tillgången med hävstångseffekt,
- c) exotiska täckta köpoptioner är täckta köpoptioner vars huvudkomponent är en kombination av optioner,
- d) överlåtbara rättigheter vars underliggande instrument är ett icke-aktierelaterade instrument,
- e) investeringscertifikat är certifikat som följer resultaten för den underliggande tillgången utan hävstångseffekt.

RTS2#3 = SDRV

För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska följande metod tillämpas

alla värdepapperiserade derivat anses ha en likvid marknad.

▼B

Tabell 4.2

Värdepapperiserade derivat – SSTI och LIS tröskelvärden före och efter handel

Tillgångsklass – Värdepapperiserade derivat			
SSTI och LIS tröskelvärden före och efter handel			
SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
EUR 50 000	EUR 60 000	EUR 90 000	EUR 100 000

5. Räntederivat

▼M3

Tabell 5.1

Räntederivat – klasser som inte har en likvid marknad

Tillgångsklass – Räntederivat			
-------------------------------	--	--	--

varje kontrakt enligt definition i bilaga I, avsnitt C 4 i direktiv 2014/65/EU vars yttersta underliggande är en ränta, en obligation, ett lån, vilken korg, portfölj eller index som helst som omfattar en ränta, en obligation, ett lån eller någon annan produkt som motsvarar resultatet av en ränta, en obligation, ett lån.

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
Obligationsterminer (futures/forwards) / Future på en obligationsfuture	underklasser av obligationsterminer definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 (RTS2#17) – utfärdare av det underliggande Uppdelningskriterium 2 (RTS2#18) – löptid för den underliggande obligationen enligt följande definition:	EUR 5 000 000	10	när en underklass anses ha en likvid marknad med avseende på ett visst löptidsintervall och den underklass som definieras av nästa löptidsintervall inte anses ha en likvid marknad, ska

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
<p>/ Forward på en obligationsfuture</p> <p>”Future på en obligation</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = FUTR</p> <p>RTS2#16 = BOND</p> <p>eller</p> <p>Forward på en obligation</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = FORW</p> <p>RTS2#16 = BOND</p> <p>eller</p> <p>Future på en obligationsfuture</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p>	<p>Kort sikt: den underliggande obligationen med en löptid upp till 4 år ska anses vara kortfristig</p> <p>Medellång sikt: den underliggande obligationen med en löptid mellan 4 och 8 år ska anses vara medellång</p> <p>Lång sikt: den underliggande obligationen med en löptid mellan 8 och 15 år ska anses vara långfristig</p> <p>Mycket lång sikt: den underliggande obligationen med en löptid längre än 15 år ska anses vara mycket långfristig</p> <p>Uppdelningskriterium 3 – futurens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 3$ månader</p> <p>Löptidsintervall 2: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 6$ månader</p> <p>Löptidsintervall 3: $6 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1$ år</p> <p>Löptidsintervall 4: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2$ år</p> <p>Löptidsintervall 5: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3$ år</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n$ år</p>			<p>det första (back month) kontraktet anses ha en likvid marknad 2 veckor innan (front month) har löpt ut</p>

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
RTS2#5 = FUTR RTS2#16 = BNFD eller Forward på en obligationsfuture RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = FORW RTS2#16 = BNFD				
Obligationsoption / Option på en obligationsoption / Option på en obligationsfuture Obligationsoption Option på en obligationsoption RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR	underklasser av obligationsindexoptioner definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 (RTS2#22) – slutlig underliggande obligation Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8) – optionens löptidsintervall definierat enligt följande: Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 3$ månader Löptidsintervall 2: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 6$ månader Löptidsintervall 3: $6 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1$ år Löptidsintervall 4: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2$ år Löptidsintervall 5: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3$ år ... Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n$ år	EUR 5 000 000	10	

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
<p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#16 = BOND</p> <p>eller</p> <p>Option på en obligationsoption</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#16 = BOND</p> <p>eller</p> <p>Option på en obligationsfuture</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#16 = BNFD</p>				

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
<p>IR futures och FRA/Future på en räntefuture/Räntetermin på en räntefuture</p> <p>Future på en räntefuture</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = FUTR</p> <p>RTS2#16 = INTR</p> <p>eller</p> <p>Räntetermin</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = FRAS</p> <p>RTS2#16 = INTR</p> <p>eller</p> <p>Future på en räntefuture</p>	<p>underklasser av räntefutures definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS2#24)– underliggande räntesats</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#25) – löptid för underliggande räntesats</p> <p>Uppdelningskriterium 3 (RTS2#8) – futures löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 3$ månader</p> <p>Löptidsintervall 2: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 6$ månader</p> <p>Löptidsintervall 3: $6 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1$ år =</p> <p>Löptidsintervall 4: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2$ år =</p> <p>Löptidsintervall 5: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3$ år</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n$ år</p>	EUR 500 000 000	10	när en underklass anses ha en likvid marknad med avseende på ett visst löptidsintervall och den underklass som definieras av nästa löptidsintervall inte anses ha en likvid marknad, ska det första (back month) kontraktet anses ha en likvid marknad 2 veckor innan (front month) har löpt ut

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
<p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = FUTR</p> <p>RTS2#16 = IFUT</p> <p>eller</p> <p>Räntetermin på en räntefuture</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = FRAS</p> <p>RTS2#16 = IFUT</p>				
<p>Ränteoptioner</p> <p>/Option på en räntefuture/FRA</p> <p>/Option på en ränteoption</p>	<p>underklasser av räntefutures definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS2#24) – underliggande räntesats</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#25) – löptid för underliggande räntesats</p> <p>Uppdelningskriterium 3 (RTS2#8) – optionens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 3$ månader</p>	EUR 500 000 000	10	

▼ **M3**

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
/Option på en option på en räntefuture/FRA Option på en räntefuture/FRA// Option på en ränteoption RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR ... RTS2#5 = OPTN RTS2#16 = IFUT eller Ränteoption//Option på en option på en räntefuture/FRA RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = OPTN RTS2#16 = INTR	Löptidsintervall 2: 3 månader < löptid ≤ 6 månader Löptidsintervall 3: 6 månader < löptid ≤ 1 år Löptidsintervall 4: 1 år < löptid ≤ 2 år Löptidsintervall 5: 2 år < löptid ≤ 3 år ... Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år			

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
Swapoptioner RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = SWPT	Underklasser av swapoptioner definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 (RTS2#16) – underliggande typ av swap enligt följande: Swap vars komponenter är denominerade i samma valuta (single currency swap) för fast kontra fast ränta (fixed-to-fixed) och terminer (futures/forwards) på denna [RTS2#16 = XXSC] enkel valutaswap för fast kontra rörlig ränta och terminer (futures/forwards) på denna [RTS2#16 = XFSC] enkel valutaswap för rörlig kontra rörlig ränta och terminer på dessa [RTS2#16 = FFSC] enkel inflationsswap och terminer (futures/forwards) på denna [RTS2#16 = IFSC] OIS- kontrakt (Overnight Index Swap) med enkel valuta och terminer (futures/forwards) på detta [RTS2#16 = OSSC] valutaswap i flera valutor (multi-currency swap) för fast kontra fast ränta (fixed-to-fixed) och terminer (futures/forwards) på denna [RTS2#16 = XXMC]	EUR 500 000 000	10	

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
	<p>valutaswap i flera olika valutor för fast kontra rörlig ränta och terminer på denna [RTS2#16 = XFMC]</p> <p>valutaswap i flera valutor för rörlig kontra rörlig ränta och terminer på denna [RTS2#16 = FFMC]</p> <p>inflationsswap i flera valutor och terminer på denna [RTS2#16 = IFMC]</p> <p>OIS-kontrakt i flera olika valutor och terminer på detta [RTS2#16 = OSMC]</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#20) – teoretisk valuta definierad som den valuta i vilken det teoretiska beloppet för optionen är denominerat</p> <p>Uppdelningskriterium 3 (RTS2#22 eller RTS2#23) – inflationsindex om underliggande swap antingen är en enkel inflationsvalutaswap (<i>inflation single currency swap</i>) eller en inflationsvalutaswap i flera valutor (<i>inflation multi-currency swap</i>)</p> <p>Uppdelningskriterium 4 (RTS2#21) – swappens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1$ månad</p> <p>Löptidsintervall 2: $1 \text{ månad} < \text{löptid} \leq 3$ månader</p>			

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
	<p>Löptidsintervall 3: 3 månader < löptid ≤ 6 månader</p> <p>Löptidsintervall 4: 6 månader < löptid ≤ 1 år</p> <p>Löptidsintervall 5: 1 år < löptid ≤ 2 år</p> <p>Löptidsintervall 6: 2 år < löptid ≤ 3 år</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år</p> <p>Uppdelningskriterium 5 (RTS2#8) – optionens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 6 månader</p> <p>Löptidsintervall 2: 6 månader < löptid ≤ 1 år</p> <p>Löptidsintervall 3: 1 år < löptid ≤ 2 år</p> <p>Löptidsintervall 4: 2 år < löptid ≤ 5 år</p> <p>Löptidsintervall 5: 5 år < löptid ≤ 10 år</p> <p>Löptidsintervall 6: över 10 år</p>			

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
<p>Valutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (multi-currency swaps) eller valutaswappar vars komponenter är denominerade i två valutor (cross-currency swaps) för fast kontra rörlig ränta (fixed-to-float) och terminer (futures/forwards)/optioner på dessa</p> <p>en swap eller en termin (future/forward)/option på en swap där två parter utbyter kassaflöden i olika valutor och där kassaflöden i den ena delen bestäms av en fast ränta och kassaflödena i den andra delen bestäms av en rörlig ränta.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP eller FONS eller FWOS eller OPTS</p> <p>RTS2#16 = XFMC</p>	<p>en underklass av valutaswappar för fast kontra rörlig ränta definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#13 och RTS23#42) – teoretiskt valutapar definierat som en kombination av de två valutor i vilken de två delarna för swappen är denominerade</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8) – swappens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: 0 månader < löptid ≤ 1 månad</p> <p>Löptidsintervall 2: 0 månader < löptid ≤ 3 månader</p> <p>Löptidsintervall 3: 3 månader < löptid ≤ 6 månader</p> <p>Löptidsintervall 4: 6 månader < löptid ≤ 1 år</p> <p>Löptidsintervall 5: 1 år < löptid ≤ 2 år</p> <p>Löptidsintervall 6: 2 år < löptid ≤ 3 år</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år</p>	EUR 50 000 000	10	

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
<p>Valutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (multi-currency swaps) eller valutaswappar vars komponenter är denominerade i två valutor (cross-currency swaps) för rörlig kontra rörlig ränta (float-to-float) och terminer (futures/forwards)/optioner på dessa</p> <p>en swap eller en termin (future/forward)/option på en swap där två parter utbyter kassaflöden i olika valutor och där kassaflöden i båda delarna bestäms av en rörlig ränta</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP eller FONS eller FWOS eller OPTS</p> <p>RTS2#16 = FFMC</p>	<p>en underklass av valutaswappar för rörlig kontra rörlig ränta definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#13 och RTS23#42) – teoretiskt valutapar definierat som en kombination av de två valutor i vilken de två delarna för swappen är denominerade</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8) – swappens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: 0 månader < löptid ≤ 1 månad</p> <p>Löptidsintervall 2: 0 månader < löptid ≤ 3 månader</p> <p>Löptidsintervall 3: 3 månader < löptid ≤ 6 månader</p> <p>Löptidsintervall 4: 6 månader < löptid ≤ 1 år</p> <p>Löptidsintervall 5: 1 år < löptid ≤ 2 år</p> <p>Löptidsintervall 6: 2 år < löptid ≤ 3 år</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år</p>	EUR 50 000 000	10	

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
<p>Valutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (multi-currency swaps) eller valutaswappar vars komponenter är denominerade i två valutor (cross-currency swaps) för fast kontra fast ränta (fixed-to-fixed) och terminer (futures/forwards)/optioner på dessa</p> <p>en swap eller en termin (future/forward)/option på en swap där två parter utbyter kassaflöden i olika valutor och där kassaflöden i båda delarna bestäms av en fast ränta</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP eller FONS eller FWOS eller OPTS</p> <p>RTS2#16 = XXMC</p>	<p>en underklass av valutaswappar för fast kontra fast ränta definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#13 och RTS23#42) – teoretiskt valutapar definierat som en kombination av de två valutor i vilken de två delarna för swappen är denominerade</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8) – swappens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1 \text{ månad}$</p> <p>Löptidsintervall 2: $1 \text{ månad} < \text{löptid} \leq 3 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 3: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 6 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 4: $6 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 5: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 6: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3 \text{ år}$</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n \text{ år}$</p>	EUR 50 000 000	10	

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
<p>OIS-kontrakt (Overnight Index Swap), valutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (multi-currency swaps) eller valutaswappar vars komponenter är denominerade i två valutor (cross-currency swaps) och terminer (futures/forwards)/optioner på dessa</p> <p>en swap eller en termin (future/forward) på en swap där två parter utbyter kassaflöden i olika valutor och där kassaflöden i åtminstone en del bestäms av en OIS-ränta (Overnight Index Swap)</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP eller FONS eller FWOS eller OPTS</p> <p>RTS2#16 = OSMC</p>	<p>underklass av OIS-swap i flera valutor definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#13 och RTS23#42) – teoretiskt valutapar definierat som en kombination av de två valutor i vilken de två delarna för swappen är denominerade</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8) – swappens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1 \text{ månad}$</p> <p>Löptidsintervall 2: $1 \text{ månad} < \text{löptid} \leq 3 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 3: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 6 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 4: $6 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 5: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 6: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3 \text{ år}$</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n \text{ år}$</p>	EUR 50 000 000	10	

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
<p>Inflationsvalutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (inflation multi-currency swaps) eller inflationsvalutaswappar vars komponenter är denominerade i två valutor (inflation cross-currency swaps) och terminer (futures/forwards)/optioner på dessa</p> <p>en swap eller en termin (future/forward)/option på en swap där två parter utbyter kassaflöden i olika valutor och där kassaflödena i åtminstone en del bestäms av en inflationstakt</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP eller FONS eller FWOS eller OPTS</p> <p>RTS2#16 = IFMC</p>	<p>en underklass av flera inflationsvalutor definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#13 och RTS23#42) – teoretiskt valutapar definierat som en kombination av de två valutor i vilken de två delarna för swappen är denominerade</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8) – swappens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1 \text{ månad}$</p> <p>Löptidsintervall 2: $1 \text{ månad} < \text{löptid} \leq 3 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 3: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 6 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 4: $6 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 5: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 6: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3 \text{ år}$</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n \text{ år}$</p>	EUR 50 000 000	10	

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
<p>Swappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (single currency swaps) för fast kontra rörlig ränta (fixed-to-float) och terminer (futures/forwards)/optioner på dessa</p> <p>en swap eller en termin (future/forward)/option på en swap där två parter utbyter kassaflöden i samma valuta och där kassaflöden i den ena delen bestäms av en fast ränta, medan kassaflöden i den andra delen bestäms av en rörlig ränta</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP eller FONS eller FWOS eller OPTS</p> <p>RTS2#16 = XFSC</p>	<p>en underklass av valutaswappar för fast kontra rörlig ränta definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#13) – teoretisk valuta definierad som den valuta i vilken båda delarna av swappen är denominerade</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8) – swappens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1 \text{ månad}$</p> <p>Löptidsintervall 2: $1 \text{ månad} < \text{löptid} \leq 3 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 3: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 6 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 4: $6 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 5: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 6: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3 \text{ år}$</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n \text{ år}$</p>	EUR 50 000 000	10	

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
<p>Swappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (single currency swaps) för rörlig kontra rörlig ränta (float-to-float) och terminer (futures/forwards)/optioner på dessa</p> <p>en swap eller en termin (future/forward)/option på en swap där två parter utbyter kassaflöden i samma valuta och där kassaflöden i båda delarna bestäms av en rörlig ränta</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP eller FONS eller FWOS eller OPTS</p> <p>RTS2#16 = FFSC</p>	<p>en underklass av valutaswappar för fast kontra fast ränta definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#13) – teoretisk valuta definierad som den valuta i vilken båda delarna av swappen är denominerade</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8) – swappens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1 \text{ månad}$</p> <p>Löptidsintervall 2: $1 \text{ månad} < \text{löptid} \leq 3 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 3: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 6 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 4: $6 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 5: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 6: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3 \text{ år}$</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n \text{ år}$</p>	EUR 50 000 000	10	

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
<p>Swappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (single currency swaps) för fast kontra fast ränta (fixed-to-fixed) och terminer (futures/forwards)/optioner på dessa</p> <p>en swap eller en termin (future/forward)/option på en swap där två parter utbyter kassaflöden i samma valuta och där kassaflöden i båda delarna bestäms av en fast ränta</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP eller FONS eller FWOS eller OPTS</p> <p>RTS2#16 = XXSC</p>	<p>en underklass av enkla valutor för fast kontra fast ränta definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#13) – teoretisk valuta definierad som den valuta i vilken båda delarna av swappen är denominerade</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8) – swappens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1 \text{ månad}$</p> <p>Löptidsintervall 2: $1 \text{ månad} < \text{löptid} \leq 3 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 3: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 6 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 4: $6 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 5: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 6: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3 \text{ år}$</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n \text{ år}$</p>	EUR 50 000 000	10	

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
<p>OIS-kontrakt (Overnight Index Swap) och swappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (single currency swaps) och terminer (futures/forwards)/optioner på dessa</p> <p>en swap eller en termin (future/forward) på en swap där två parter utbyter kassaflöden i samma valuta och där kassaflöden i åtminstone en del bestäms av en OIS- ränta (Overnight Index Swap)</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP eller FONS eller FWOS eller OPTS</p> <p>RTS2#16 = OSSC</p>	<p>underklass av OIS-swap i en valuta definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#13) – teoretisk valuta definierad som den valuta i vilken båda delarna av swappen är denominerade</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8) – swappens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1 \text{ månad}$</p> <p>Löptidsintervall 2: $1 \text{ månad} < \text{löptid} \leq 3 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 3: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 6 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 4: $6 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 5: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 6: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3 \text{ år}$</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n \text{ år}$</p>	EUR 50 000 000	10	

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Kompletterande kvalitativt likviditetskriterium
<p>Inflationssvappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (inflation single currency swaps) och terminer (futures/forwards)/optioner på dessa</p> <p>en swap eller en termin (future/forward)/option på en swap där två parter utbyter kassaflöden i samma valuta och där kassaflödena i åtminstone en del bestäms av en inflationstakt</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = INTR</p> <p>RTS2#5 = SWAP eller FONS eller FWOS eller OPTS</p> <p>RTS2#16 = IFSC</p>	<p>en underklass av enkla inflationsvalutor definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#13) – teoretisk valuta definierad som den valuta i vilken båda delarna av swappen är denominerade</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8) – swappens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1 \text{ månad}$</p> <p>Löptidsintervall 2: $1 \text{ månad} < \text{löptid} \leq 3 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 3: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 6 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 4: $6 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 5: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 6: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3 \text{ år}$</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n \text{ år}$</p>	EUR 50 000 000	10	

▼ M3

Tillgångsklass – Räntederivat	
Underklass till tillgångsklassen	för att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska följande metod tillämpas
Övriga räntederivat räntederivat som inte omfattas av någon av ovanstående underklasser till tillgångsklassen RTS2#3 = DERV RTS2#4 = INTR RTS2#5 = OTHR	samtliga övriga räntederivat anses inte ha en likvid marknad

Tabell 5.2

Räntederivat – tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som anses ha en likvid marknad

Tillgångsklass – Räntederivat														
Underklass till tillgångsklassen	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för varje underklass som anses ha en likvid marknad													
	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel			LIS efter handel			
		Handel – percentil				Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde
Obligationsterminer (futures/forwards)	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 20 000 000	90	70	EUR 25 000 000
		30	40	50	60									
Obligationsoptioner	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 20 000 000	90	70	EUR 25 000 000
		30	40	50	60									

▼B

Tillgångsklass – Räntederivat														
Underklass till tillgångsklassen	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för varje underklass som anses ha en likvid marknad													
	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel			LIS efter handel			
		Handel – percentil				Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde
Ränteterminer och FRA	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 5 000 000	70	EUR 10 000 000	80	60	EUR 20 000 000	90	70	EUR 25 000 000
		30	40	50	60									
Ränteoptioner	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 5 000 000	70	EUR 10 000 000	80	60	EUR 20 000 000	90	70	EUR 25 000 000
		30	40	50	60									

▼B

Tillgångsklass – Räntederivat														
Underklass till tillgångsklassen	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för varje underklass som anses ha en likvid marknad													
	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel			LIS efter handel			
		Handel – percentil				Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde
Swapoptioner	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									
Valutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (multi-currency swaps) eller valutaswappar vars komponenter är denominerade i två valutor (cross-currency swaps) för fast kontra rörlig ränta (fixed-to-float) och terminer (futures/forwards) på dessa	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									

Tillgångsklass – Räntederivat														
Underklass till tillgångsklassen	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för varje underklass som anses ha en likvid marknad													
	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel			LIS efter handel			
		Handel – percentil				Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde
Valutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (multi-currency swaps) eller valutaswappar vars komponenter är denominerade i två valutor (cross-currency swaps) för rörlig kontra rörlig ränta (float-to-float) och terminer (futures/forwards) på dessa	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									
Valutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (multi-currency swaps) eller valutaswappar vars komponenter är denominerade i två valutor (cross-currency swaps) för fast kontra fast ränta (fixed-to-fixed) och terminer (futures/forwards) på dessa	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									

Tillgångsklass – Räntederivat														
Underklass till tillgångsklassen	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för varje underklass som anses ha en likvid marknad													
	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel			LIS efter handel			
		Handel – percentil				Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde
OIS-kontrakt (Overnight Index Swap), valutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (multi-currency swaps) eller valutaswappar vars komponenter är denominerade i två valutor (cross-currency swaps) och terminer (futures/forwards) på dessa	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									
Inflationsvalutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (inflation multi-currency swaps) eller inflationsvalutaswappar vars komponenter är denominerade i två valutor (inflation cross-currency swaps) och terminer (futures/forwards) på dessa	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									

▼B

Tillgångsklass – Räntederivat														
Underklass till tillgångsklassen	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för varje underklass som anses ha en likvid marknad													
	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel			LIS efter handel			
		Handel – percentil				Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde
Swappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (single currency swaps) för fast kontra rörlig ränta (fixed-to-float) och terminer (futures/forwards) på dessa	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									
Swappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (single currency swaps) för rörlig kontra rörlig ränta (float-to-float) och terminer (futures/forwards) på dessa	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									

▼B

Tillgångsklass – Räntederivat														
Underklass till tillgångsklassen	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för varje underklass som anses ha en likvid marknad													
	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel			LIS efter handel			
		Handel – percentil				Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde
Swappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (single currency swaps) för fast kontra fast ränta (fixed-to-fixed) och terminer (futures/forwards) på dessa	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									
OIS-kontrakt (Overnight Index Swap) och swappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (single currency swaps) och terminer (futures/forwards) på dessa	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									

Tillgångsklass – Räntederivat														
Underklass till tillgångsklassen	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för varje underklass som anses ha en likvid marknad													
	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel			LIS efter handel			
		Handel – percentil				Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde
Inflationssvappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (inflation single currency swaps) och terminer (futures/forwards) på dessa	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 4 000 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 9 000 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									

Tabell 5.3

Räntederivat – tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som inte anses ha en likvid marknad

Tillgångsklass – Räntederivat				
Underklass till tillgångsklassen	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för varje underklass som inte anses ha en likvid marknad			
	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
Obligationsterminer (futures/forwards)	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Obligationsoptioner	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Ränteterminer och FRA	EUR 5 000 000	EUR 10 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000

Tillgångsklass – Räntederivat				
Underklass till tillgångsklassen	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för varje underklass som inte anses ha en likvid marknad			
	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
Ränteoptioner	EUR 5 000 000	EUR 10 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Swaptioner	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
Valutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (multi-currency swaps) eller valutaswappar vars komponenter är denominerade i två valutor (cross-currency swaps) för fast kontra rörlig ränta (fixed-to-float) och terminer (futures/forwards) på dessa	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
Valutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (multi-currency swaps) eller valutaswappar vars komponenter är denominerade i två valutor (cross-currency swaps) för rörlig kontra rörlig ränta (float-to-float) och terminer (futures/forwards) på dessa	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
Valutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (multi-currency swaps) eller valutaswappar vars komponenter är denominerade i två valutor (cross-currency swaps) för fast kontra fast ränta (fixed-to-fixed) och terminer (futures/forwards) på dessa	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
OIS-kontrakt (Overnight Index Swap), valutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (multi-currency swaps) eller valutaswappar vars komponenter är denominerade i två valutor (cross-currency swaps) och terminer (futures/forwards) på dessa	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
Inflationsvalutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (inflation multi-currency swaps) eller inflationsvalutaswappar vars komponenter är denominerade i två valutor (inflation cross-currency swaps) och terminer (futures/forwards) på dessa	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
Swappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (single currency swaps) för fast kontra rörlig ränta (fixed-to-float) och terminer (futures/forwards) på dessa	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000

▼B

Tillgångsklass – Räntederivat				
Underklass till tillgångsklassen	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för varje underklass som inte anses ha en likvid marknad			
	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
Swappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (single currency swaps) för rörlig kontra rörlig ränta (float-to-float) och terminer (futures/forwards) på dessa	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
Swappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (single currency swaps) för fast kontra fast ränta (fixed-to-fixed) och terminer (futures/forwards) på dessa	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
OIS-kontrakt (Overnight Index Swap) och swappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (single currency swaps) och terminer (futures/forwards) på dessa	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
Inflationsswappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (inflation single currency swaps) och terminer (futures/forwards) på dessa	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000
Övriga räntederivat	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 9 000 000	EUR 10 000 000

6. Aktiederivat

▼M3

Tabell 6.1

Aktiederivat – klasser som inte har en likvid marknad

Tillgångsklass – Aktiederivat
alla kontrakt enligt definitionen i avsnitt C.4 i bilaga I i direktiv 2014/65/EU som avser
a) enstaka eller flera aktier, depåbevis, börshandlade fonder, certifikat, andra liknande finansiella instrument, kassaflöden eller andra produkter kopplade till resultatet av enstaka eller flera aktier, depåbevis, börshandlade fonder, certifikat eller andra liknande finansiella instrument,
b) ett index bestående av aktier, depåbevis, börshandlade fonder, certifikat, andra liknande finansiella instrument, kassaflöden eller andra produkter kopplade till resultatet av enstaka eller flera aktier, depåbevis, börshandlade fonder, certifikat eller andra liknande finansiella instrument

Tillgångsklass – Aktiederivat	
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska följande metod tillämpas
<p>Aktieindexoptioner</p> <p>optioner där det underliggande är ett index som består av aktier</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = STIX</p> <p>RTS23#26 eller, om tomt, RTS23#28</p>	<p>alla indexoptioner anses ha en likvid marknad</p>
<p>Aktieindexterminer (futures/forwards)</p> <p>terminer där det underliggande är ett index som består av aktier</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI'</p> <p>RTS2#5 = FUTR eller FORW</p> <p>RTS2#27 = STIX</p> <p>RTS23#26 eller, om tomt, RTS23#28</p>	<p>alla indexterminer anses ha en likvid marknad</p>
<p>Aktieoptioner</p> <p>optioner där det underliggande är en aktie eller en korg av aktier som är resultatet av en bolagshändelse</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI'</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = SHRS</p> <p>RTS23#26 eller, om tomt, RTS23#28</p>	<p>alla aktieoptioner anses ha en likvid marknad</p>

Tillgångsklass – Aktiederivat	
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska följande metod tillämpas
<p>Aktieterminer (futures/forwards) terminer där det underliggande är en aktie eller en korg av aktier som är resultatet av en bolagshändelse RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = FUTR eller FORW RTS2#27 = SHRS RTS23#26 eller, om tomt, RTS23#28</p>	<p>alla aktieterminer anses ha en likvid marknad</p>
<p>Optioner på aktieutdelning optioner på utdelningen från en specifik aktie RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = OPTN RTS2#27 = DVSE RTS23#26 eller, om tomt, RTS23#28</p>	<p>alla optioner på aktieutdelning anses ha en likvid marknad</p>
<p>Terminer (futures/forwards) på aktieutdelning terminer på utdelningen från en specifik aktie RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = FUTR eller FORW RTS2#27 = DVSE RTS23#26 eller, om tomt, RTS23#28</p>	<p>alla terminer på aktieutdelning anses ha en likvid marknad</p>

Tillgångsklass – Aktierderivat	
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska följande metod tillämpas
<p>Optioner på aktieutdelningsindex</p> <p>optioner på ett index som består av utdelningar från mer än en aktie</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI'</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = DIVI</p> <p>RTS23#26 eller, om tomt, RTS23#28</p>	<p>alla optioner på aktieutdelningsindex anses ha en likvid marknad</p>
<p>Terminer (futures/forwards) på aktieutdelningsindex</p> <p>terminer på ett index som består av utdelningar från mer än en aktie</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI'</p> <p>RTS2#5 = FUTR eller FORW</p> <p>RTS2#27 = DIVI</p> <p>RTS23#26 eller, om tomt, RTS23#28</p>	<p>alla terminer på aktieutdelningsindex anses ha en likvid marknad</p>
<p>Volatilitetsindexoptioner</p> <p>optioner där det underliggande är ett volatilitetsindex definierat som ett index kopplat till volatiliteten hos ett specifikt underliggande index av aktieinstrument</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI'</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = VOLI</p> <p>RTS23#26 eller, om tomt, RTS23#28</p>	<p>alla volatilitetsindexoptioner anses ha en likvid marknad</p>

Tillgångsklass – Aktiederivat	
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska följande metod tillämpas
<p>Volatilitetsindexterminer (futures/forwards)</p> <p>terminer där det underliggande är ett volatilitetsindex definierat som ett index kopplat till volatiliteten hos ett specifikt underliggande index av aktieinstrument</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI'</p> <p>RTS2#5 = FUTR eller FORW</p> <p>RTS2#27 = VOLI</p> <p>RTS23#26 eller, om tomt, RTS23#28</p>	<p>alla volatilitetsindexterminer anses ha en likvid marknad</p> <p>Optioner på börshandlade fonder</p>
<p>Optioner på börshandlade fonder</p> <p>optioner där det underliggande är en ETF</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI'</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#27 = ETFS</p> <p>RTS23#26 eller, om tomt, RTS23#28</p>	<p>alla optioner på börshandlade fonder anses ha en likvid marknad</p>
<p>Terminer (futures/forwards) på börshandlade fonder</p> <p>terminer där det underliggande är en börshandlad fond</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = EQUI'</p> <p>RTS2#5 = FUTR eller FORW</p> <p>RTS2#27 = ETFS</p> <p>RTS23#26 eller, om tomt, RTS23#28</p>	<p>alla terminer på börshandlade fonder anses ha en likvid marknad</p>

Tillgångsklass – Aktiederivat				
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	
Swappar RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI' RTS2#5 = SWAP	Underklasser av swappar definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 (RTS2 # 27) – underliggande typ: ett namn, index, korg Segmenteringskriterium 2 (RTS23#26 eller, om tomt, RTS23#28) – underliggande namn, index, korg Uppdelningskriterium 3 (RTS2#28) – parameter: ”price return basic performance parameter”, ”parameter return dividend”, ”parameter return variance”, ”parameter return volatility” Uppdelningskriterium 4 (RTS2#8) – swappens löptidsintervall definierat enligt följande:			EUR 50 000 000
	”Price return basic performance parameter”	”Parameter return variance/volatility”	”Parameter return dividend”	
	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 1 månad	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 3 månader	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 1 år	
	Löptidsintervall 2: 1 månad < löptid ≤ 3 månader	Löptidsintervall 2: 3 månader < löptid ≤ 6 månader	Löptidsintervall 2: 1 år < löptid ≤ 2 år	
	Löptidsintervall 3: 3 månader < löptid ≤ 6 månader	Löptidsintervall 3: 6 månader < löptid ≤ 1 år	Löptidsintervall 3: 2 år < löptid ≤ 3 år	
	Löptidsintervall 4: 6 månader < löptid ≤ 1 år	Löptidsintervall 4: 1 år < löptid ≤ 2 år	...	

Tillgångsklass – Aktiederivat					
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande			Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier	
				Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
	Löptidsintervall 5: 1 år < löptid ≤ 2 år	Löptidsintervall 5: 2 år < löptid ≤ 3 år	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år		
	Löptidsintervall 6: 2 år < löptid ≤ 3 år	...			
	...	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år			
	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år				
Portföljswappar RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = PSWP	Underklassen portföljswappar bestäms av en specifik kombination av Uppdelningskriterium 1 (RTS2 # 27) – underliggande typ: ett namn, index, korg Segmenteringskriterium 2 (RTS23#26 eller, om tomt, RTS23#28) – underliggande ett namn, index, korg Uppdelningskriterium 3 (RTS2#28) — parameter: ”price return basic performance parameter”, ”parameter return dividend”, ”parameter return variance”, ”parameter return volatility” Uppdelningskriterium 4 (RTS2#8) – portföljswappens löptidsintervall definierat enligt följande: Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 1 månad Löptidsintervall 2: 1 månad < löptid ≤ 3 månad Löptidsintervall 3: 3 månad < löptid ≤ 6 månad Löptidsintervall 4: 6 månader < löptid ≤ 1 år Löptidsintervall 5: 1 år < löptid ≤ 2 år Löptidsintervall 6: 2 år < löptid ≤ 3 år ... Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år			EUR 50 000 000	15

▼ M3

Tillgångsklass – Aktiederivat	
Underklass till tillgångsklassen	för att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska följande metod tillämpas:
<p>Övriga kreditderivat kreditderivat som inte omfattas av någon av ovanstående underklasser till tillgångsklassen</p> <p>RTS2#3 = DERV RTS2#4 = EQUI RTS2#5 = OTHR'</p>	övriga aktiederivat anses inte ha en likvid marknad

▼ B

Tabell 6.2

Aktiederivat – tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som anses ha en likvid marknad

Tillgångsklass – Aktiederivat							
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) som fastställts för underklasser som anses ha en likvid marknad baserat på det band för genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) som gäller för underklassen				
			Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA)	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
				Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
Aktieindexoptioner	underklasser av aktieindexoptioner definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 – underliggande aktieindex	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	< EUR 100 miljoner ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000
			EUR 100 miljoner ≤ ADNA < EUR 200 miljoner	EUR 2 500 000	EUR 3 000 000	EUR 25 000 000	EUR 30 000 000
			EUR 200 miljoner ≤ ADNA < EUR 600 miljoner	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000	EUR 50 000 000	EUR 55 000 000
			ADNA ≥ EUR 600 miljoner	EUR 15 000 000	EUR 20 000 000	EUR 150 000 000	EUR 160 000 000

Tillgångsklass – Aktierderivat							
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) som fastställts för underklasser som anses ha en likvid marknad baserat på det band för genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) som gäller för underklassen				
			Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA)	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
				Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
Aktieindexterminer (futures/forwards)	underklasser av aktieindexterminer definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 – underliggande aktieindex	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	< EUR 100 miljoner ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000
			EUR 100 miljoner ≤ ADNA < EUR 1 miljard	EUR 500 000	EUR 550 000	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000
			EUR 1 miljard ≤ ADNA < EUR 3 miljarder	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000	EUR 50 000 000	EUR 55 000 000
			EUR 3 miljarder ≤ ADNA < EUR 5 miljarder	EUR 15 000 000	EUR 20 000 000	EUR 150 000 000	EUR 160 000 000
			ADNA ≥ EUR 5 miljarder	EUR 25 000 000	EUR 30 000 000	EUR 250 000 000	EUR 260 000 000
Aktieoptioner	underklasser av aktieindexoptioner definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 – underliggande aktie	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	< EUR 5 miljoner ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 250 000
			EUR 5 miljoner ≤ ADNA < EUR 10 miljoner	EUR 250 000	EUR 300 000	EUR 1 250 000	EUR 1 500 000
			EUR 10 miljoner ≤ ADNA < EUR 20 miljoner	EUR 500 000	EUR 550 000	EUR 2 500 000	EUR 3 000 000
			ADNA ≥ EUR 20 miljoner	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000

Tillgångsklass – Aktierderivat							
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) som fastställts för underklasser som anses ha en likvid marknad baserat på det band för genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) som gäller för underklassen				
			Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA)	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
				Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
Aktieterminer (futures/forwards)	underklasser av aktieterminer definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 – underliggande aktie	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	< EUR 5 miljoner ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 250 000
			EUR 5 miljoner ≤ ADNA < EUR 10 miljoner	EUR 250 000	EUR 300 000	EUR 1 250 000	EUR 1 500 000
			EUR 10 miljoner ≤ ADNA < EUR 20 miljoner	EUR 500 000	EUR 550 000	EUR 2 500 000	EUR 3 000 000
			ADNA ≥ EUR 20 miljoner	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000
Optioner på aktieutdelning	underklasser av optioner på aktieutdelning definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 – underliggande aktie som ger rätt till utdelning	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	< EUR 5 miljoner ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 400 000	EUR 450 000
			EUR 5 miljoner ≤ ADNA < EUR 10 miljoner	EUR 25 000	EUR 30 000	EUR 500 000	EUR 550 000
			EUR 10 miljoner ≤ ADNA < EUR 20 miljoner	EUR 50 000	EUR 100 000	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000
			ADNA ≥ EUR 20 miljoner	EUR 100 000	EUR 150 000	EUR 2 000 000	EUR 2 500 000

Tillgångsklass – Aktierderivat							
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) som fastställts för underklasser som anses ha en likvid marknad baserat på det band för genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) som gäller för underklassen				
			Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA)	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
				Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
Terminer (futures/forwards) på aktieutdelning	underklasser av terminer på aktieutdelning definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 – underliggande aktie som ger rätt till utdelning	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	< EUR 5 miljoner ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 400 000	EUR 450 000
			EUR 5 miljoner ≤ ADNA < EUR 10 miljoner	EUR 25 000	EUR 30 000	EUR 500 000	EUR 550 000
			EUR 10 miljoner ≤ ADNA < EUR 20 miljoner	EUR 50 000	EUR 100 000	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000
			ADNA ≥ EUR 20 miljoner	EUR 100 000	EUR 150 000	EUR 2 000 000	EUR 2 500 000
Optioner på aktieutdelningsindex	underklasser av optioner på aktieutdelningsindex definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 – underliggande aktieutdelningsindex	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	< EUR 100 miljoner ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000
			EUR 100 miljoner ≤ ADNA < EUR 200 miljoner	EUR 2 500 000	EUR 3 000 000	EUR 25 000 000	EUR 30 000 000
			EUR 200 miljoner ≤ ADNA < EUR 600 miljoner	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000	EUR 50 000 000	EUR 55 000 000
			ADNA ≥ EUR 600 miljoner	EUR 15 000 000	EUR 20 000 000	EUR 150 000 000	EUR 160 000 000

Tillgångsklass – Aktierderivat							
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) som fastställts för underklasser som anses ha en likvid marknad baserat på det band för genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) som gäller för underklassen				
			Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA)	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
				Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
Terminer (futures/forwards) på aktieutdelningsindex	underklasser av terminer på aktieutdelningsindex definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 – underliggande aktieutdelningsindex	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	< EUR 100 miljoner ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000
			EUR 100 miljoner ≤ ADNA < EUR 1 miljard	EUR 500 000	EUR 550 000	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000
			EUR 1 miljard ≤ ADNA < EUR 3 miljarder	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000	EUR 50 000 000	EUR 55 000 000
			EUR 3 miljarder ≤ ADNA < EUR 5 miljarder	EUR 15 000 000	EUR 20 000 000	EUR 150 000 000	EUR 160 000 000
			ADNA ≥ EUR 5 miljarder	EUR 25 000 000	EUR 30 000 000	EUR 250 000 000	EUR 260 000 000
Volatilitetsindexoptioner	underklasser av volatilitetsindexoptioner definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 – underliggande volatilitetsindex	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	< EUR 100 miljoner ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000
			EUR 100 miljoner ≤ ADNA < EUR 200 miljoner	EUR 2 500 000	EUR 3 000 000	EUR 25 000 000	EUR 30 000 000
			EUR 200 miljoner ≤ ADNA < EUR 600 miljoner	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000	EUR 50 000 000	EUR 55 000 000
			ADNA ≥ EUR 600 miljoner	EUR 15 000 000	EUR 20 000 000	EUR 150 000 000	EUR 160 000 000

Tillgångsklass – Aktierderivat							
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) som fastställts för underklasser som anses ha en likvid marknad baserat på det band för genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) som gäller för underklassen				
			Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA)	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
				Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
Volatilitetsindexterminer (futures/forwards)	underklasser av volatilitetsindexterminer definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 – underliggande volatilitetsindex	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	< EUR 100 miljoner ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000
			EUR 100 miljoner ≤ ADNA < EUR 1 miljard	EUR 500 000	EUR 550 000	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000
			EUR 1 miljard ≤ ADNA < EUR 3 miljarder	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000	EUR 50 000 000	EUR 55 000 000
			EUR 3 miljarder ≤ ADNA < EUR 5 miljarder	EUR 15 000 000	EUR 20 000 000	EUR 150 000 000	EUR 160 000 000
			ADNA ≥ EUR 5 miljarder	EUR 25 000 000	EUR 30 000 000	EUR 250 000 000	EUR 260 000 000
Optioner på börshandlade fonder	underklasser av optioner på börshandlade fonder definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 – underliggande börshandlad fond	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	< EUR 5 miljoner ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 250 000
			EUR 5 miljoner ≤ ADNA < EUR 10 miljoner	EUR 250 000	EUR 300 000	EUR 1 250 000	EUR 1 500 000
			EUR 10 miljoner ≤ ADNA < EUR 20 miljoner	EUR 500 000	EUR 550 000	EUR 2 500 000	EUR 3 000 000
			ADNA ≥ EUR 20 miljoner	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000

Tillgångsklass – Aktierderivat							
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) som fastställts för underklasser som anses ha en likvid marknad baserat på det band för genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) som gäller för underklassen				
			Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA)	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
				Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
Terminer (futures/forwards) på börshandlade fonder	underklasser av terminer på börshandlade fonder definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 – underliggande börshandlad fond	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	< EUR 5 miljoner ADNA	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 1 000 000	EUR 1 250 000
			EUR 5 miljoner ≤ ADNA < EUR 10 miljoner	EUR 250 000	EUR 300 000	EUR 1 250 000	EUR 1 500 000
			EUR 10 miljoner ≤ ADNA < EUR 20 miljoner	EUR 500 000	EUR 550 000	EUR 2 500 000	EUR 3 000 000
			ADNA ≥ EUR 20 miljoner	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000
Swappar	Underklasser av swappar definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 – typ av underliggande: ett namn, index, korg Uppdelningskriterium 2 – underliggande ett namn, index, korg Uppdelningskriterium 3 – parameter: ”price return basic performance parameter”, ”parameter return dividend”, ”parameter return variance”, ”parameter return volatility” Uppdelningskriterium 4 – Swappens löptidsintervall definierat enligt följande:	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	EUR 50 miljoner ≤ ADNA < EUR 100 miljoner	EUR 250 000	EUR 300 000	EUR 1 250 000	EUR 1 500 000
			EUR 100 miljoner ≤ ADNA < EUR 200 miljoner	EUR 500 000	EUR 550 000	EUR 2 500 000	EUR 3 000 000
			ADNA ≥ EUR 200 miljoner	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000

▼B

Tillgångsklass – Aktierderivat									
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande			Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) som fastställts för underklasser som anses ha en likvid marknad baserat på det band för genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) som gäller för underklassen				
					Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA)	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
						Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
	”Price return basic performance parameter”	”Parameter return variance/volatility”	”Parameter return dividend”						
	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 1 månad	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 3 månader	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 1 år						
	Löptidsintervall 2: 1 månad < löptid ≤ 3 månader	Löptidsintervall 2: 3 månader < löptid ≤ 6 månader	Löptidsintervall 2: 1 år < löptid ≤ 2 år						
	Löptidsintervall 3: 3 månader < löptid ≤ 6 månader	Löptidsintervall 3: 6 månader < löptid ≤ 1 år	Löptidsintervall 3: 2 år < löptid ≤ 3 år						

▼B

Tillgångsklass – Aktierderivat									
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande			Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) som fastställts för underklasser som anses ha en likvid marknad baserat på det band för genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) som gäller för underklassen				
					Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA)	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
						Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
	Löptidsintervall 4: 6 månader < löptid ≤ 1 år	Löptidsintervall 4: 1 år < löptid ≤ 2 år	...						
	Löptidsintervall 5: 1 år < löptid ≤ 2 år	Löptidsintervall 5: 2 år < löptid ≤ 3 år	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år						
	Löptidsintervall 6: 2 år < löptid ≤ 3 år	...							
	...	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år							
	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år								

▼B

Tillgångsklass – Aktierderivat							
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) som fastställts för underklasser som anses ha en likvid marknad baserat på det band för genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) som gäller för underklassen				
			Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA)	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
				Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
Portföljswappar	<p>Underklassen portföljswappar bestäms av en specifik kombination av</p> <p>Uppdelningskriterium 1 – typ av underliggande: ett namn, index, korg</p> <p>Uppdelningskriterium 2 – underliggande ett namn, index, korg</p> <p>Uppdelningskriterium 3 – parameter: ”price return basic performance parameter”, ”parameter return dividend”, ”parameter return variance”, ”parameter return volatility”</p> <p>Uppdelningskriterium 4 – portföljswappens löptidsintervall definierat enligt följande:</p>	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	EUR 50 miljoner ≤ ADNA < EUR 100 miljoner	EUR 250 000	EUR 300 000	EUR 1 250 000	EUR 1 500 000
			EUR 100 miljoner ≤ ADNA < EUR 200 miljoner	EUR 500 000	EUR 550 000	EUR 2 500 000	EUR 3 000 000
			ADNA ≥ EUR 200 miljoner	EUR 1 000 000	EUR 1 500 000	EUR 5 000 000	EUR 5 500 000
	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 1 månad						
	Löptidsintervall 2: 1 månad < löptid ≤ 3 månader						
	Löptidsintervall 3: 3 månader < löptid ≤ 6 månader						

Tillgångsklass – Aktierderivat							
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) som fastställts för underklasser som anses ha en likvid marknad baserat på det band för genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) som gäller för underklassen				
			Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA)	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
				Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
	Löptidsintervall 4: 6 månader < löptid ≤ 1 år						
	Löptidsintervall 5: 1 år < löptid ≤ 2 år						
	Löptidsintervall 6: 2 år < löptid ≤ 3 år						
	...						
	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år						

Tabell 6.3

Aktierderivat – tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som inte anses ha en likvid marknad

Tillgångsklass – Aktierderivat				
Underklass till tillgångsklassen	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som inte anses ha en likvid marknad			
	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
Swappar	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 100 000	EUR 150 000
Portföljswappar	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 100 000	EUR 150 000
Övriga aktierderivat	EUR 20 000	EUR 25 000	EUR 100 000	EUR 150 000

▼B

7. Råvaruderivat

▼M3

Tabell 7.1

Råvaruderivat – klasser som inte har en likvid marknad

Tillgångsklass – Råvaruderivat				
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	
Råvaruterminer (futures/forwards) – metall RTS2#3 = "DERV" och RTS2#4 = "COMM" och RTS23#35 = "METL" och [RTS2#5 = "FUTR" eller "FORW"]	underklasser av råvaruterminer – metall definieras genom följande uppdelningskriterier:		10 000 000 EUR	10
	Uppdelningskriterium 1 (RTS23#36) — typ av metall: ädelmetaller, oädla metaller			
	Uppdelningskriterium 2 (RTS23#37) — underliggande metall			
	Uppdelningskriterium 3 (RTS2#15) — teoretisk valuta definierad som den valuta i vilken det teoretiska beloppet för terminen är denominerat			
	Uppdelningskriterium 4 (RTS2#8) — futurens/forwardens löptidsintervall definierat enligt följande:			
Ädelmetaller	Oädla metaller			
Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 3 månader	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 1 år			
Löptidsintervall 2: 3 månader < löptid ≤ 1 år	Löptidsintervall 2: 1 år < löptid ≤ 2 år			
Löptidsintervall 3: 1 år < löptid ≤ 2 år	Löptidsintervall 3: 2 år < löptid ≤ 3 år			

Tillgångsklass – Råvaruderivat				
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande		Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden	
			Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
	Löptidsintervall 4: 2 år < löptid ≤ 3 år	...		
	...	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år		
	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år			
Råvaruoptioner – metall RTS2#3 = ”DERV” och RTS2#4 = ”COMM” och RTS23#35 = ”METL” och RTS2#5 = ”OPTN”	underklasser av råvaruoptioner – metall definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 (RTS23#36) — typ av metall: ädelmetaller, oädla metaller Uppdelningskriterium 2 (RTS23#37) — underliggande metall Uppdelningskriterium 3 (RTS2#15) — teoretisk valuta definierad som den valuta i vilken det teoretiska beloppet för optionen är denominerat Uppdelningskriterium 4 (RTS2#8) — optionens löptidsintervall definierat enligt följande:		10 000 000 EUR	10
	Ädelmetaller	Oädla metaller		
	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 3 månader	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 1 år		
	Löptidsintervall 2: 3 månader < löptid ≤ 1 år	Löptidsintervall 2: 1 år < löptid ≤ 2 år		

Tillgångsklass – Råvaruderivat				
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande		Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden	
			Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
	Löptidsintervall 3: 1 år < löptid ≤ 2 år	Löptidsintervall 3: 2 år < löptid ≤ 3 år		
	Löptidsintervall 4: 2 år < löptid ≤ 3 år	...		
	...	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år		
	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år			
Råvaruswappar – metall RTS2#3 = ”DERV” och RTS2#4 = ”COMM” och RTS23#35 = ”METL” och RTS2#5 = ”SWAP”	underklasser av råvaruswappar – metall definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 (RTS23#36) — typ av metall: ädelmetaller, oädla metaller Uppdelningskriterium 2 (RTS23#37) — underliggande metall Uppdelningskriterium 3 (RTS2#15) — teoretisk valuta definierad som den valuta i vilken det teoretiska beloppet för swappen är denominerat Uppdelningskriterium 4 (RTS23#34) — typ av leverans definierad som kontant, fysisk eller annan Uppdelningskriterium 5 (RTS2#8) — swappens löptidsintervall definierat enligt följande:		10 000 000 EUR	10
	Ädelmetaller	Oädla metaller		
	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 3 månader	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 1 år		

Tillgångsklass – Råvaruderivat				
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande		Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden	
			Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
	Löptidsintervall 2: 3 månader < löptid ≤ 1 år		Löptidsintervall 2: 1 år < löptid ≤ 2 år	
	Löptidsintervall 3: 1 år < löptid ≤ 2 år		Löptidsintervall 3: 2 år < löptid ≤ 3 år	
	Löptidsintervall 4: 2 år < löptid ≤ 3 år		...	
	...		Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år	
	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år			
Råvaruterminer (futures/ forwards) – energi RTS2#3 = "DERV" och RTS2#4 = "COMM" och RTS23#35 = "NRGY" och [RTS2#5 = "FUTR" eller "FORW"]	underklasser av råvaruterminer – energi definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 (RTS23#36) – energislag: olja, oljedestillat, kol, lätta oljeprodukter, naturgas, elektricitet, kombinerade energislag Uppdelningskriterium 2 (RTS23#37) – underliggande energislag Uppdelningskriterium 3 (RTS2#15) – teoretisk valuta definierad som den valuta i vilken det teoretiska beloppet för terminen är denominerat Uppdelningskriterium 4 – [utgå]		EUR 10 000 000	10

Tillgångsklass – Råvaruderivat																								
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden																						
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]																					
	<p>Uppdelningskriterium 5 (RTS2#14) – leverans/plats för kontant avveckling; gäller för alla energislag</p> <p>Uppdelningskriterium 6 (RTS2#8) – terminens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>Olja/destillat/lätta oljeprodukter</th> <th>Kol</th> <th>Naturgas/Elektricitet/Kombinerade energislag</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 4 månader</td> <td>Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 6 månader</td> <td>Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 1 månad</td> </tr> <tr> <td>Löptidsintervall 2: 4 månader < löptid ≤ 8 månader</td> <td>Löptidsintervall 2: 6 månader < löptid ≤ 1 år</td> <td>Löptidsintervall 2: 1 månad < löptid ≤ 1 år</td> </tr> <tr> <td>Löptidsintervall 3: 8 månader < löptid ≤ 1 år</td> <td>Löptidsintervall 3: 1 år < löptid ≤ 2 år</td> <td>Löptidsintervall 3: 1 år < löptid ≤ 2 år</td> </tr> <tr> <td>Löptidsintervall 4: 1 år < löptid ≤ 2 år</td> <td>...</td> <td>...</td> </tr> <tr> <td>...</td> <td>Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år</td> <td>Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år</td> </tr> <tr> <td>Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år</td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>	Olja/destillat/lätta oljeprodukter	Kol	Naturgas/Elektricitet/Kombinerade energislag	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 4 månader	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 6 månader	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 1 månad	Löptidsintervall 2: 4 månader < löptid ≤ 8 månader	Löptidsintervall 2: 6 månader < löptid ≤ 1 år	Löptidsintervall 2: 1 månad < löptid ≤ 1 år	Löptidsintervall 3: 8 månader < löptid ≤ 1 år	Löptidsintervall 3: 1 år < löptid ≤ 2 år	Löptidsintervall 3: 1 år < löptid ≤ 2 år	Löptidsintervall 4: 1 år < löptid ≤ 2 år	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år				
Olja/destillat/lätta oljeprodukter	Kol	Naturgas/Elektricitet/Kombinerade energislag																						
Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 4 månader	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 6 månader	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 1 månad																						
Löptidsintervall 2: 4 månader < löptid ≤ 8 månader	Löptidsintervall 2: 6 månader < löptid ≤ 1 år	Löptidsintervall 2: 1 månad < löptid ≤ 1 år																						
Löptidsintervall 3: 8 månader < löptid ≤ 1 år	Löptidsintervall 3: 1 år < löptid ≤ 2 år	Löptidsintervall 3: 1 år < löptid ≤ 2 år																						
Löptidsintervall 4: 1 år < löptid ≤ 2 år																						
...	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år																						
Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år																								

Tillgångsklass – Råvaruderivat					
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden			
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]		
Råvaruoptioner – energi RTS2#3 = ”DERV” och RTS2#4 = ”COMM” och RTS23#35 = ”NRGY” och RTS2#5 = ”OPTN”	underklasser av råvaruoptioner – energi definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 (RTS23#36) – energislag: olja, oljedestillat, kol, lätta oljeprodukter, naturgas, elektricitet, kombinerade energislag Uppdelningskriterium 2 (RTS23#37) – underliggande energislag Uppdelningskriterium 3 (RTS2#15) – teoretisk valuta definierad som den valuta i vilken det teoretiska beloppet för optionen är denominerat Uppdelningskriterium 4 – [utgår] Uppdelningskriterium 5 (RTS2#14) – leverans/plats för kontant avveckling; gäller för alla energislag Uppdelningskriterium 6 (RTS2#8) – optionens löptidsintervall definierat enligt följande:			EUR 10 000 000	10
	Olja/destillat/lätta oljeprodukter	Kol	Naturgas/Elektricitet/ Kombinerade energislag		
	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 4 månader	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 6 månader	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 1 månad		
	Löptidsintervall 2: 4 månader < löptid ≤ 8 månader	Löptidsintervall 2: 6 månader < löptid ≤ 1 år	Löptidsintervall 2: 1 månad < löptid ≤ 1 år		

Tillgångsklass – Råvaruderivat					
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande			Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden	
				Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
	Löptidsintervall 3: 8 månader < löptid ≤ 1 år	Löptidsintervall 3: 1 år < löptid ≤ 2 år	Löptidsintervall 3: 1 år < löptid ≤ 2 år		
	Löptidsintervall 4: 1 år < löptid ≤ 2 år		
	...	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år		
	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år				
Råvaruswappar– energi RTS2 #3 = ”DERV” och RTS2#4 = ”COMM” och RTS2#35 = ”NRGY” och RTS2#5 = ”SWAP”	underklasser av råvaruswappar – energi definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 (RTS23#36) – energislag: olja, oljedestillat, kol, lätta oljeprodukter, naturgas, elektricitet, kombinerade energislag Uppdelningskriterium 2 (RTS23#37) – underliggande energislag Uppdelningskriterium 4 (RTS23#34) – teoretisk valuta definierad som den valuta i vilken det teoretiska beloppet för swappen är denominerat Uppdelningskriterium 4 (RTS23#34) – typ av leverans definierad som kontant, fysisk eller annan Uppdelningskriterium 5 – [utgår] Uppdelningskriterium 6 (RTS2#14) – leverans/plats för kontant avveckling; gäller för alla energislag Uppdelningskriterium 7 (RTS2#8) – swappens löptidsintervall definierat enligt följande:			EUR 10 000 000	10

Tillgångsklass – Råvaruderivat					
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande			Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden	
				Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
	Olja/destillat/lätta oljeprodukter	Kol	Naturgas/Elektricitet/Kombinerade energislag		
	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 4 månader	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 6 månader	Löptidsintervall 1: 0 < löptid ≤ 1 månad		
	Löptidsintervall 2: 4 månader < löptid ≤ 8 månader	Löptidsintervall 2: 6 månader < löptid ≤ 1 år	Löptidsintervall 2: 1 månad < löptid ≤ 1 år		
	Löptidsintervall 3: 8 månader < löptid ≤ 1 år	Löptidsintervall 3: 1 år < löptid ≤ 2 år	Löptidsintervall 3: 1 år < löptid ≤ 2 år		
	Löptidsintervall 4: 1 år < löptid ≤ 2 år		
	...	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år		
	Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år				
Råvaruterminer (futures/forwards) – jordbruksprodukter RTS2#3 = "DERV" och RTS2#4 = "COMM" och RTS23#35 = "AGRI" och [RTS2#5 = "FUTR" eller "FORW"]	underklasser av råvaruterminer – jordbruksprodukter definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 (RTS23#36 och RTS23#37) – underliggande jordbruksprodukt (underprodukt och ytterligare underprodukt) Uppdelningskriterium 2 (RTS2#15) – teoretisk valuta definierad som den valuta i vilken det teoretiska beloppet för terminen är denominerat			EUR 10 000 000	10

Tillgångsklass – Råvaruderivat			
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden	
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
	<p>Uppdelningskriterium 3 (RTS2#8) – terminens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 3$ månader</p> <p>Löptidsintervall 2: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 6$ månader</p> <p>Löptidsintervall 3: $6 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1$ år</p> <p>Löptidsintervall 4: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2$ år</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n$ år</p>		
<p>Råvaruoptioner – jordbruksprodukter</p> <p>RTS2#3 = "DERV" och RTS2#4 = "COMM" och RTS23#35 = "AGRI" och RTS2#5 = "OPTN"</p>	<p>underklasser av råvaruoptioner – jordbruksprodukter definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#36 och RTS23#37) – underliggande jordbruksprodukt (underprodukt och ytterligare underprodukt)</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#15) – teoretisk valuta definierad som den valuta i vilken det teoretiska beloppet för optionen är denominerat</p> <p>Uppdelningskriterium 3 (RTS2#8) – optionens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 3$ månader</p> <p>Löptidsintervall 2: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 6$ månader</p> <p>Löptidsintervall 3: $6 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1$ år</p> <p>Löptidsintervall 4: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2$ år</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n$ år</p>	EUR 10 000 000	10

Tillgångsklass – Råvaruderivat			
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden	
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
Råvaruswappar – jordbruksprodukter RTS2 #3 = ”DERV” och RTS2#4 = ”COMM” och RTS23#35 = ”AGRI” och RTS2#5 = ”SWAP”	underklasser av råvaruswappar – jordbruksprodukter definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 (RTS23#36 och RTS23#37) – underliggande jordbruksprodukt (underprodukt och ytterligare underprodukt) Uppdelningskriterium 2 (RTS2#15) – teoretisk valuta definierad som den valuta i vilken det teoretiska beloppet för swappen är denominerat Uppdelningskriterium 3 (RTS23#34) – typ av leverans definierad som kontant, fysisk eller annan Uppdelningskriterium 4 (RTS2#8) – swappens löptidsintervall definierat enligt följande: Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 3$ månader Löptidsintervall 2: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 6$ månader Löptidsintervall 3: $6 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1$ år Löptidsintervall 4: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2$ år ... Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n$ år	EUR 10 000 000	10
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska följande metod tillämpas		
Övriga råvaruderivat råvaruderivat som inte omfattas av någon av ovanstående underklasser till tillgångsklassen	samtliga övriga råvaruderivat anses inte ha en likvid marknad		

Tabell 7.2

Råvaruderivat – tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som anses ha en likvid marknad

Tillgångsklass – Råvaruderivat														
Underklass till tillgångsklassen	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för underklasser som anses ha en likvid marknad													
	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel			LIS efter handel			
		Handel – percentil				Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde
Råvaruterminer (futures/ forwards) – metall	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 250 000	70	EUR 500 000	80	60	EUR 750 000	90	70	EUR 1 000 000
		30	40	50	60									
Råvaruoptioner – metall	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 250 000	70	EUR 500 000	80	60	EUR 750 000	90	70	EUR 1 000 000
		30	40	50	60									

▼B

Tillgångsklass – Råvaruderivat														
Underklass till tillgångsklassen	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för underklasser som anses ha en likvid marknad													
	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel			LIS efter handel			
		Handel – percentil				Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde
Råvaruswappar – metall	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 250 000	70	EUR 500 000	80	60	EUR 750 000	90	70	EUR 1 000 000
		30	40	50	60									
Råvaruterminer (futures/forwards) – energi	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 250 000	70	EUR 500 000	80	60	EUR 750 000	90	70	EUR 1 000 000
		30	40	50	60									
Råvaruoptioner – energi	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för	S1	S2	S3	S4	EUR 250 000	70	EUR 500 000	80	60	EUR 750 000	90	70	EUR 1 000 000
		30	40	50	60									

Tillgångsklass – Råvaruderivat														
Underklass till tillgångsklassen	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för underklasser som anses ha en likvid marknad													
	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel			LIS efter handel			
		Handel – percentil				Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde
	finansiella instrument som tillhör den underklassen													
Råvaruswappar– energi	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 250 000	70	EUR 500 000	80	60	EUR 750 000	90	70	EUR 1 000 000
		30	40	50	60									
Råvaruterminer (futures/ forwards) – jordbruksprodukter	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 250 000	70	EUR 500 000	80	60	EUR 750 000	90	70	EUR 1 000 000
		30	40	50	60									

▼B

Tillgångsklass – Råvaruderivat														
Underklass till tillgångsklassen	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för underklasser som anses ha en likvid marknad													
	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel			LIS efter handel			
		Handel – percentil				Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde
Råvaruoptioner – jordbruksprodukter	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1 30	S2 40	S3 50	S4 60	EUR 250 000	70	EUR 500 000	80	60	EUR 750 000	90	70	EUR 1 000 000
Råvaruswappar – jordbruksprodukter	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1 30	S2 40	S3 50	S4 60	EUR 250 000	70	EUR 500 000	80	60	EUR 750 000	90	70	EUR 1 000 000

Tabell 7.3

Råvaruderivat – tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som inte anses ha en likvid marknad

Tillgångsklass – Råvaruderivat				
Underklass till tillgångsklassen	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som inte anses ha en likvid marknad			
	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
Råvaruterminer (futures/forwards) – metall	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000
Råvaruoptioner – metall	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000
Råvaruswappar – metall	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000
Råvaruterminer (futures/forwards) – energi	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000
Råvaruoptioner – energi	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000
Råvaruswappar – energi	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000
Råvaruterminer (futures/forwards) – jordbruksprodukter	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000
Råvaruoptioner – jordbruksprodukter	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000
Råvaruswappar – jordbruksprodukter	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000
Övriga råvaruderivat	EUR 250 000	EUR 500 000	EUR 750 000	EUR 1 000 000

▼B

8. Valutaderivat

▼M3

Tabell 8.1

Valutaderivat – klasser som inte har en likvid marknad

Tillgångsklass – Valutaderivat			
finansiella instrument som avser valutor enligt definitionen i avsnitt C.4 i bilaga I till direktiv 2014/65/EU			
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier	
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
<p>Icke-levererbar termin (NDF)</p> <p>En termin som, enligt villkoren, avvecklas kontant mellan parterna, och avvecklingsbeloppet bestäms av skillnaden i växelkurs mellan de två valutorna på handelsdagen och på värderingsdagen. På avvecklingsdagen är den ena parten skyldig den andra parten nettoskillnaden mellan i) den växelkurs som fastställts på handelsdagen, och ii) växelkursen på värderingsdagen, baserat på det teoretiska beloppet, varvid nettobeloppet ska betalas i den avvecklingsvaluta som anges i avtalet.</p> <p>RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FORW RTS2#26 = NDLV</p>	<p>underklasser av icke-levererbara valutaterminer definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#13 och RTS23#47) – underliggande valutapar definierat som kombinationen av de två underliggande valutorna för derivatkontraktet</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8)– terminens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1$ vecka</p> <p>Löptidsintervall 2: $1 \text{ vecka} < \text{löptid} \leq 3$ månader</p> <p>Löptidsintervall 3: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1$ år</p> <p>Löptidsintervall 4: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2$ år</p> <p>Löptidsintervall 5: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3$ år</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n$ år</p>	Icke-levererbara terminer (NDF) anses inte ha en likvid marknad	

Tillgångsklass – Valutaderivat			
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier	
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
<p>Levererbar termin (DF)</p> <p>En termin som enbart avser växling av två olika valutor på en viss framtida avtalad avvecklingsdag till en fastställd kurs som är avtalad vid ingåendet av växlingskontraktet.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = FORW</p> <p>RTS2#26 = DLVB</p>	<p>underklasser av levererbara valutaterminer definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#13 and RTS23#47) – underliggande valutapar definierat som kombinationen av de två underliggande valutorna för derivatkontraktet</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8) – terminens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1 \text{ vecka}$</p> <p>Löptidsintervall 2: $1 \text{ vecka} < \text{löptid} \leq 3 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 3: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 4: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 5: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3 \text{ år}$</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n \text{ år}$</p>	Levererbara terminer (DF) anses inte ha en likvid marknad	

Tillgångsklass – Valutaderivat			
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier	
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
<p>Icke-levererbar valutaoption (NDO)</p> <p>En option som, enligt villkoren, avvecklas kontant mellan parterna, och avvecklingsbeloppet bestäms av skillnaden i växelkurs mellan de två valutorna på handelsdagen och på värderingsdagen. På avvecklingsdagen är den ena parten skyldig den andra parten nettoskillnaden mellan i) den växelkurs som fastställts på handelsdagen, och ii) växelkursen på värderingsdagen, baserat på det teoretiska beloppet, varvid nettobeloppet ska betalas i den avvecklingsvaluta som anges i avtalet.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR'</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#26 = NDLV</p>	<p>underklasser av icke-levererbara valutaoptioner definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#13 och RTS23#47) underliggande valutapar definierat som kombinationen av de två underliggande valutorna för derivatkontraktet</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8)– optionens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1 \text{ vecka}$</p> <p>Löptidsintervall 2: $1 \text{ vecka} < \text{löptid} \leq 3 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 3: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 4: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 5: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3 \text{ år}$</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n \text{ år}$</p>	Icke-levererbara valutaoptioner (NDO) anses inte ha en likvid marknad	

Tillgångsklass – Valutaderivat			
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier	
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
<p>Levererbar valutaoption (DO)</p> <p>En option som enbart avser växling av två olika valutor på en viss framtida avtalad avvecklingsdag till en fastställd kurs som är avtalad vid ingåendet av växlingskontraktet.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = OPTN</p> <p>RTS2#26 = DLVB</p>	<p>underklasser av levererbara valutaoptioner definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#13 and RTS23#47) – underliggande valutapar definierat som kombinationen av de två underliggande valutorna för derivatkontraktet</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8)– optionens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1 \text{ vecka}$</p> <p>Löptidsintervall 2: $1 \text{ vecka} < \text{löptid} \leq 3 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 3: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 4: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 5: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3 \text{ år}$</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n \text{ år}$</p>	Levererbara valutaoptioner (DO) anses inte ha en likvid marknad	

Tillgångsklass – Valutaderivat			
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier	
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
<p>Icke-levererbar valutaswap (NDS)</p> <p>En swap som, enligt villkoren, avvecklas kontant mellan parterna, och avvecklingsbeloppet bestäms av skillnaden i växelkurs mellan de två valutorna på handelsdagen och på värderingsdagen. På avvecklingsdagen är den ena parten skyldig den andra parten nettoskillnaden mellan i) den växelkurs som fastställts på handelsdagen, och ii) växelkursen på värderingsdagen, baserat på det teoretiska beloppet, varvid nettobeloppet ska betalas i den avvecklingsvaluta som anges i avtalet.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR'</p> <p>RTS2#5 = SWAP</p> <p>RTS2#26 = NDLV</p>	<p>underklasser av icke-levererbara valutaswappar definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#13 and RTS23#47) – underliggande valutapar definierat som kombinationen av de två underliggande valutorna för derivatkontraktet</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8) – swappens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1 \text{ vecka}$</p> <p>Löptidsintervall 2: $1 \text{ vecka} < \text{löptid} \leq 3 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 3: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 4: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 5: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3 \text{ år}$</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n \text{ år}$</p>	Icke-levererbara valutaswappar (NDS) anses inte ha en likvid marknad	

Tillgångsklass – Valutaderivat			
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier	
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
<p>Levererbar valutaswap (DS)</p> <p>En swap som enbart avser växling av två olika valutor på en viss framtida avtalad avvecklingsdag till en fastställd kurs som är avtalad vid ingåendet av växlingskontraktet.</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CURR</p> <p>RTS2#5 = SWAP</p> <p>RTS2#26 = DLVB</p>	<p>underklasser av levererbara valutaswappar definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#13 och RTS23#47) – underliggande valutapar definierat som kombinationen av de två underliggande valutorna för derivatkontraktet</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8) – swappens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1 \text{ vecka}$</p> <p>Löptidsintervall 2: $1 \text{ vecka} < \text{löptid} \leq 3 \text{ månader}$</p> <p>Löptidsintervall 3: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 4: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 5: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3 \text{ år}$</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n \text{ år}$</p>	<p>Levererbara valutaswappar (DS) anses inte ha en likvid marknad</p>	

Tillgångsklass – Valutaderivat			
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier	
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
Valutaterminer RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = FUTR	underklasser av valutaterminer definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 (RTS23#13 och RTS23#47) – underliggande valutapar definierat som kombinationen av de två underliggande valutorna för derivatkontraktet Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8) – futurens löptidsintervall definierat enligt följande: Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1$ vecka Löptidsintervall 2: $1 \text{ vecka} < \text{löptid} \leq 3$ månader Löptidsintervall 3: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1$ år Löptidsintervall 4: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2$ år Löptidsintervall 5: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3$ år ... Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n$ år	Valutaterminer anses inte ha en likvid marknad	
Tillgångsklass – Valutaderivat			
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska följande metod tillämpas		
Övriga valutaderivat valutaderivat som inte omfattas av någon av ovanstående underklasser till tillgångsklassen RTS2#3 = DERV RTS2#4 = CURR RTS2#5 = OTHR	samtliga övriga valutaderivat anses inte ha en likvid marknad		

Tabell 8.2

Valutaderivat – tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som inte anses ha en likvid marknad

Tillgängsklass – Valutaderivat				
Underklass till tillgängsklassen	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som inte anses ha en likvid marknad			
	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
Icke-levererbar termin (NDF)	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Levererbar termin (DF)	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Icke-levererbar valutaoption (NDO)	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Levererbar valutaoption (DO)	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Icke-levererbar valutaswap (NDS)	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Levererbar valutaswap (DS)	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Valutaterminer	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000
Övriga valutaderivat	EUR 4 000 000	EUR 5 000 000	EUR 20 000 000	EUR 25 000 000

▼B

9. Kreditderivat

▼M3

Tabell 9.1

Kreditderivat – klasser som inte har en likvid marknad

Tillgångsklass – Kreditderivat				
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier. För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Indexets "on-the-run status" [ytterligare kvalitativt likviditetskriterium]
<p>Indexerade creditswappar (CDS) swappar där utbytet av kassaflöden är kopplat till kreditvärdigheten hos flera emittenter av finansiella instrument som utgör ett index, och förekomsten av kredithändelser</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT</p>	<p>underklasser av creditswappar definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS2#34) – underliggande index</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#42) – teoretisk valuta definierad som den valuta i vilken det teoretiska beloppet för derivatet är denominerat</p> <p>Uppdelningskriterium 3 (RTS2#8) – creditswappens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1$ år</p> <p>Löptidsintervall 2: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2$ år</p> <p>Löptidsintervall 3: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3$ år</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n$ år</p>	EUR 200 000 000	10	<p>Det underliggande indexet anses ha en likvid marknad</p> <p>1) under hela tiden när det har "on-the-run status"</p> <p>2) under de första 30 arbetsdagarna när det har "1x off-the-run status"</p> <p>med "on-the-run"-index avses den rullande mest aktuella versionen (serien) av indexet vilken skapas den dag då indexets sammansättning börjar gälla och slutar en dag före dagen då sammansättning av nästa version (serie) av indexet börjar gälla</p> <p>med "1x off-the-run status" avses versionen (serien) av indexet direkt före den aktuella "on-the-run"-versionen (-serien) vid en viss tidpunkt. En version (serie) upphör att vara "on-the-run" och får statusen "1x off-the-run" när den senaste versionen (serien) av indexet skapas.</p>

Tillgångsklass – Kreditderivat				
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier. För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Indexets "on-the-run status" [ytterligare kvalitativt likviditetskriterium]
<p>Kreditswappar (CDS) som refererar till ett namn swappar där utbytet av kassaflöden är kopplat till kreditvärdigheten hos en emittent av finansiella instrument, och förekomsten av kredithändelser</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT</p>	<p>underklasser av kreditswappar som refererar till ett namn definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS2#41) – underliggande referensenhet</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#39) – underliggande typ av referensenhet definierad enligt följande: Emittent av statlig och offentlig typ: en emitterande enhet som är något av följande:</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#39) – underliggande typ av referensenhet definierad enligt följande: Emittent av statlig och offentlig typ: en emitterande enhet som är något av följande:</p> <p>a) unionen,</p> <p>b) en medlemsstat, inbegripet förvaltningar, organ eller specialföretag i medlemsstaten,</p> <p>c) en statlig enhet som inte omfattas av leden a och b,</p> <p>d) när det gäller en federal medlemsstat, en delstat i den federationen,</p> <p>e) ett specialföretag för flera medlemsstater,</p> <p>f) en internationell finansinstitution som etablerats av minst två medlemsstater och vars mål är att uppbåda finansiering och tillhandahålla finansiellt bistånd till de medlemmar som har eller riskerar att få allvarliga finansieringsproblem,</p>	EUR 10 000 000	10	

Tillgångsklass – Kreditderivat				
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier. För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt		
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	Indexets "on-the-run status" [ytterligare kvalitativt likviditetskriterium]
	<p>g) Europeiska investeringsbanken,</p> <p>h) en offentlig enhet som inte är en statlig emittent enligt leden a–c.</p> <p>Emittent av bolagstyp: en emitterande enhet som inte är en emittent av statlig och offentlig typ.</p> <p>Uppdelningskriterium 3 (RTS2#42) – teoretisk valuta definierad som den valuta i vilken det teoretiska beloppet för derivatet är denominerat</p> <p>Uppdelningskriterium 4 (RTS2#8) – kreditswappens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1$ år</p> <p>Löptidsintervall 2: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2$ år</p> <p>Löptidsintervall 3: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3$ år</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n$ år</p>			
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller följande kvalitativa likviditetskriterier		
Kreditindexoptioner (CDS index options) optioner där det underliggande är ett kreditindex	underklasser av kreditindexoptioner definieras genom följande uppdelningskriterier:	en kreditindexoption vars underliggande kreditindex är en underklass som anses ha en likvid marknad och vars löptidsintervall är 0–6 månader, anses ha en likvid marknad		

Tillgångsklass – Kreditderivat			
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier. För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt	
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
<p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT</p>	<p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#26) – underklass till kreditindex enligt vad som anges för underklassen kreditindex (CDS)</p> <p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8) – optionens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 6$ månad</p> <p>Löptidsintervall 2: $6 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1$ år</p> <p>Löptidsintervall 3: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2$ år</p> <p>Löptidsintervall 4: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3$ år</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n$ år</p>	<p>en kreditindexoption vars underliggande kreditindex är en underklass som anses ha en likvid marknad och vars löptidsintervall inte är 0–6 månader, anses inte ha en likvid marknad</p> <p>en kreditindexoption vars underliggande kreditindex är en underklass som inte anses ha en likvid marknad, anses inte ha en likvid marknad för något löptidsintervall Optioner på kreditswappar (CDS) som refererar till ett namn</p>	
<p>Optioner på kreditswappar (CDS) som refererar till ett namn optioner där det underliggande är en kreditswap som refererar till ett namn</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT</p>	<p>underklasser av optioner på kreditswappar som refererar till ett namn definieras genom följande uppdelningskriterier:</p> <p>Uppdelningskriterium 1 (RTS23#26) – Underklass till kreditswappar som refererar till ett namn enligt vad som anges för underklassen kreditswappar som refererar till ett namn</p>	<p>en option på en på en kreditswap som refererar till ett namn vars underliggande kreditswap som refererar till ett namn är en underklass som anses ha en likvid marknad och vars löptidsintervall är 0–6 månader, anses ha en likvid marknad</p> <p>en option på en på en kreditswap som refererar till ett namn vars underliggande kreditswap som refererar till ett namn är en underklass som anses ha en likvid marknad och vars löptidsintervall inte är 0–6 månader, anses inte ha en likvid marknad</p>	

Tillgångsklass – Kreditderivat			
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier. För underklasser som anses ha en likvid marknad ska det kompletterande kvalitativa likviditetskriteriet användas, om tillämpligt	
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
	<p>Uppdelningskriterium 2 (RTS2#8) – optionens löptidsintervall definierat enligt följande:</p> <p>Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 6 \text{ månad}$</p> <p>Löptidsintervall 2: $6 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 3: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2 \text{ år}$</p> <p>Löptidsintervall 4: $2 \text{ år} < \text{löptid} \leq 3 \text{ år}$</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: $(n-1) \text{ år} < \text{löptid} \leq n \text{ år}$</p>	en option på en creditswap som refererar till ett namn vars underliggande creditswap som refererar till ett namn är en underklass som inte anses ha en likvid marknad, anses inte ha en likvid marknad för något löptidsintervall	
Tillgångsklass – Kreditderivat			
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska följande metod tillämpas		
<p>Övriga kreditderivat kreditderivat som inte omfattas av någon av ovanstående underklasser till tillgångsklassen</p> <p>RTS2#3 = DERV</p> <p>RTS2#4 = CRDT RTS2#5 = OTHR</p>	samtliga övriga kreditderivat anses inte ha en likvid marknad		

Tabell 9.2

Kreditderivat – tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som anses ha en likvid marknad

Tillgångsklass – Kreditderivat														
Underklass till tillgångsklassen	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för underklasser som anses ha en likvid marknad													
	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel			LIS efter handel			
		Handel – percentil				Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde
Indexerade kreditwappar (CDS)	Tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 2 500 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 7 500 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									
Kreditswappar (CDS) som refererar till ett namn	Tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 2 500 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 7 500 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									

Tillgångsklass – Kreditderivat														
Underklass till tillgångsklassen	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för underklasser som anses ha en likvid marknad													
	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel			LIS efter handel			
		Handel – percentil				Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde
Kreditindexoptioner (CDS index options)	Tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 2 500 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 7 500 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									
Optioner på kreditwappar (CDS) som refererar till ett namn	Tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 2 500 000	70	EUR 5 000 000	80	60	EUR 7 500 000	90	70	EUR 10 000 000
		30	40	50	60									

Tabell 9.3

Kreditderivat – tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som inte anses ha en likvid marknad

Tillgångsklass – Kreditderivat				
Underklass till tillgångsklassen	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som inte anses ha en likvid marknad			
	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
Indexerade creditswappar (CDS)	EUR 2 500 000	EUR 5 000 000	EUR 7 500 000	EUR 10 000 000
Kreditswappar (CDS) som refererar till ett namn	EUR 2 500 000	EUR 5 000 000	EUR 7 500 000	EUR 10 000 000
Kreditindexoptioner (CDS index options)	EUR 2 500 000	EUR 5 000 000	EUR 7 500 000	EUR 10 000 000
Optioner på creditswappar (CDS) som refererar till ett namn	EUR 2 500 000	EUR 5 000 000	EUR 7 500 000	EUR 10 000 000
Övriga kreditderivat	EUR 2 500 000	EUR 5 000 000	EUR 7 500 000	EUR 10 000 000

▼ B

10. C10-derivat

▼ M3

Tabell 10.1

C10-derivat – klasser som inte har en likvid marknad

Tillgångsklass – C10-derivat			
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier	
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
Fraktderivat finansiella instrument som avser fraktavgifter enligt definitionen i avsnitt C.10 i bilaga I till direktiv 2014/65/EU RTS2 #3 = "DERV" och RTS2#4 = "COMM" och RTS23#35 = "FRGT"	underklasser av fraktderivat definieras genom följande uppdelningskriterier: Uppdelningskriterium 1 (RTS2 # 5) – kontraktstyp: futures eller options Uppdelningskriterium 2 (RTS23#36) — fraktslag Uppdelningskriterium 3 (RTS2#37) – underkategori av fraktslag Uppdelningskriterium 4 (RTS2#12)– specificering av storlek avseende underkategori av fraktslag Uppdelningskriterium 5 (RTS2#13) — medelvärde för specifik rutt eller tidsbefraktning Uppdelningskriterium 6 (RTS2#8) – derivatets löptidsintervall definierat enligt följande: Löptidsintervall 1: $0 < \text{löptid} \leq 1 \text{ månad}$ Löptidsintervall 2: $1 \text{ månad} < \text{löptid} \leq 3 \text{ månader}$ Löptidsintervall 3: $3 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 6 \text{ månader}$ Löptidsintervall 4: $6 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 9 \text{ månader}$ Löptidsintervall 5: $9 \text{ månader} < \text{löptid} \leq 1 \text{ år}$ Löptidsintervall 6: $1 \text{ år} < \text{löptid} \leq 2 \text{ år}$	EUR 10 000 000	10

Tillgångsklass – C10-derivat			
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier	
		Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
	<p>Löptidsintervall 7: 2 år < löptid ≤ 3 år</p> <p>...</p> <p>Löptidsintervall m: (n-1) år < löptid ≤ n år</p>		
Tillgångsklass – C10-derivat			
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska följande metod tillämpas		
<p>Övriga C10-derivat</p> <p>finansiella instrument enligt definitionen i avsnitt C.10 i bilaga I till direktiv 2014/65/EU som inte är fraktderivat, samtliga följande underklasser till räntederivat: Inflationsvalutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (inflation multi-currency swaps) eller inflationsvalutaswappar vars komponenter är denominerade i två valutor (inflation cross-currency swaps) och terminer (futures/forwards) på dessa, inflationsvalutaswappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (inflation single currency swaps) och terminer (futures/forwards) på dessa, samt samtliga följande underklasser av aktiederivat: volatilitetsindexoptioner, volatilitetsindexterminer, swappar med ”parameter return variance”, swappar med ”parameter return volatility”, portföljswappar med ”parameter return variance”, portföljswappar med ”parameter return volatility”</p>	samtliga övriga C10-derivat anses inte ha en likvid marknad		

Tabell 10.2

C10-derivat – tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som anses ha en likvid marknad

Tillgångsklass – C10-derivat														
Underklass till tillgångsklassen	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för underklasser som anses ha en likvid marknad													
	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel			LIS efter handel			
		Handel – percentil				Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde
Fraktderivat	tröskelvärdena ska beräknas för varje underklass av underklassen till tillgångsklassen med beaktande av transaktioner som utförts för finansiella instrument som tillhör den underklassen	S1	S2	S3	S4	EUR 25 000	70	EUR 50 000	80	60	EUR 75 000	90	70	EUR 100 000
		30	40	50	60									

Tabell 10.3

C10-derivat – tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som inte anses ha en likvid marknad

Tillgångsklass – C10-derivat					
Underklass till tillgångsklassen	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som inte anses ha en likvid marknad				
	SSTI före handel		LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
	Tröskelvärde		Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
Fraktderivat	EUR 25 000		EUR 50 000	EUR 75 000	EUR 100 000
Övriga C10-derivat	EUR 25 000		EUR 50 000	EUR 75 000	EUR 100 000

▼B

11. Finansiella kontrakt avseende prisdifferenser (CFD:er)

▼M3

Tabell 11.1

CFD:er – klasser som inte har en likvid marknad

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Kvalitativt likviditetskriterium	Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
Valuta-CFD:er RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = CURR	underklasser av valuta-CFD:er definieras genom underliggande valutapar som definieras som en kombination av de båda underliggande valutorna i CFD-/spread betting-kontraktet. RTS2#30 och RTS2#31		EUR 50 000 000	100
Råvara CFD:er RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = COMM	underklasser av råvara-CFD:er definieras genom den underliggande råvaran i CFD-/spread betting-kontraktet RTS23#35 och RTS23#36 och RTS23#37		EUR 50 000 000	100
Aktie-CFD:er RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = EQUI	underklasser av aktie-CFD:er definieras genom det underliggande aktierelaterade värdepappret i CFD-/spread betting-kontraktet RTS23/26	underklasser av aktie-CFD:er anses ha en likvid marknad om det underliggande är ett aktierelaterat värdepapper för vilket det finns en likvid marknad som är fastställd enligt artikel 2.1.17 b i förordning (EU) nr 600/2014		
Obligations-CFD:er RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = BOND	underklasser av obligations-CFD:er definieras genom underliggande obligation eller obligationsfuture i CFD-/spread betting-kontraktet RTS23/26	underklasser av obligations-CFD:er anses ha en likvid marknad om det underliggande är en obligation eller obligationsfuture för vilken det finns en likvid marknad som är fastställd enligt artiklarna 6 och 8.1 b		

▼ M3

Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska varje underklass till tillgångsklassen delas upp i underklasser enligt följande	Kvalitativt likviditetskriterium	Genomsnittligt dagligt teoretiskt belopp (ADNA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
CFD:er på en aktietermin (future/forward) RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = FTEQ	underklasser av CFD:er på en aktietermin definieras genom den underliggande aktieterminen i CFD-/spread betting-kontraktet RTS23/26	underklasser av CFD:er på en aktietermin anses ha en likvid marknad om det underliggande är en aktietermin för vilken det finns en likvid marknad fastställd i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b		
CFD:er på en aktieoption RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OPEQ	underklasser av CFD:er på en aktieoption definieras genom den underliggande aktieoptionen i CFD-/spread betting-kontraktet RTS23/26	underklasser av CFD:er på en aktieoption anses ha en likvid marknad om det underliggande är en aktieoption för vilken det finns en likvid marknad fastställd i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b		
Tillgångsklass – Finansiella kontrakt avseende prisdifferenser (CFD:er)				
Underklass till tillgångsklassen	För att fastställa klasser av finansiella instrument som inte anses ha en likvid marknad i enlighet med artiklarna 6 och 8.1 b ska följande metod tillämpas			
Övriga CFD:er				
CFD-/spread betting-kontrakt som inte omfattas av någon av ovanstående underklasser till tillgångsklassen RTS2#3 = DERV RTS2#5 = CFDS RTS2#29 = OTHR	samtliga övriga CFD-/spread betting-kontrakt anses inte ha en likvid marknad			

Tabell 11.2

CFD:er – tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som anses ha en likvid marknad

Tillgångsklass – Finansiella kontrakt avseende prisdifferenser (CFD:er)														
Underklass till tillgångsklassen	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för underklasser som anses ha en likvid marknad													
	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel			LIS efter handel			
		Handel – percentil		Lägsta tröskelvärde		Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde	
Valuta-CFD:er	transaktioner utförda för valuta-CFD:er som anses ha en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b	S1	S2	S3	S4	EUR 50 000	70	EUR 60 000	80	60	EUR 90 000	90	70	EUR 100 000
		30	40	50	60									
Råvaru-CFD:er	transaktioner utförda för råvaru-CFD:er som anses ha en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b	S1	S2	S3	S4	EUR 50 000	70	EUR 60 000	80	60	EUR 90 000	90	70	EUR 100 000
		30	40	50	60									
Aktie-CFD:er	transaktioner utförda för aktie-CFD:er som anses ha en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b	S1	S2	S3	S4	EUR 50 000	70	EUR 60 000	80	60	EUR 90 000	90	70	EUR 100 000
		30	40	50	60									

▼B

Tillgångsklass – Finansiella kontrakt avseende prisdifferenser (CFD:er)														
Underklass till tillgångsklassen	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för underklasser som anses ha en likvid marknad													
	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel			LIS efter handel			
		Handel – percentil				Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Volym – percentil	Lägsta tröskelvärde
Obligations-CFD:er	transaktioner utförda för obligations-CFD:er som anses ha en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b	S1	S2	S3	S4	EUR 50 000	70	EUR 60 000	80	60	EUR 90 000	90	70	EUR 100 000
		30	40	50	60									
CFD:er på en aktieremin (future/forward)	transaktioner utförda för CFD:er på en aktiefuture som anses ha en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b	S1	S2	S3	S4	EUR 50 000	70	EUR 60 000	80	60	EUR 90 000	90	70	EUR 100 000
		30	40	50	60									
CFD:er på en aktieoption	transaktioner utförda för CFD:er på en aktieoption som anses ha en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b	S1	S2	S3	S4	EUR 50 000	70	EUR 60 000	80	60	EUR 90 000	90	70	EUR 100 000
		30	40	50	60									

Tabell 11.3

CFD:er – tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som inte anses ha en likvid marknad

Tillgångsklass – Finansiella kontrakt avseende prisdifferenser (CFD:er)				
Underklass till tillgångsklassen	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som inte anses ha en likvid marknad			
	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
Valuta-CFD:er	EUR 50 000	EUR 60 000	EUR 90 000	EUR 100 000
Råvaru-CFD:er	EUR 50 000	EUR 60 000	EUR 90 000	EUR 100 000
Aktie-CFD:er	EUR 50 000	EUR 60 000	EUR 90 000	EUR 100 000
Obligations-CFD:er	EUR 50 000	EUR 60 000	EUR 90 000	EUR 100 000
CFD:er på en aktietermin (future/forward)	EUR 50 000	EUR 60 000	EUR 90 000	EUR 100 000
CFD:er på en aktieoption	EUR 50 000	EUR 60 000	EUR 90 000	EUR 100 000
Övriga CFD-/spread betting-kontrakt	EUR 50 000	EUR 60 000	EUR 90 000	EUR 100 000

▼B

12. Utsläppsrätter

▼M3

Tabell 12.1

Utsläppsrätter – klasser som inte har en likvid marknad

Tillgångsklass – Utsläppsrätter		
Underklass till tillgångsklassen	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier	
	Genomsnittligt dagligt belopp (ADA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
<p>EU-utsläppsrätter (EUA)</p> <p>enheter som har erkänts med avseende på kraven i Europaparlamentets och rådets direktiv 2003/87/EG (systemet för handel med utsläppsrätter)⁽¹⁾ och som ger rätt att släppa ut motsvarande ett ton koldioxid (ton koldioxidekvivalenter – tCO₂e)</p> <p>RTS2#3 = EMAL och RTS2#11 = EUAE</p>	150 000 ton koldioxidekvivalenter	5
<p>EU-utsläppsrätter för luftfart (EUAA)</p> <p>enheter som har erkänts med avseende på kraven i direktiv 2003/87/EG (systemet för handel med utsläppsrätter) och som ger rätt att släppa ut motsvarande ett ton koldioxid (ton koldioxidekvivalenter – tCO₂e) från luftfart</p> <p>RTS2#3 = EMAL och RTS2#11 = EUAA</p>	150 000 ton koldioxidekvivalenter	5
<p>Certifierade utsläppsminskningar (CER)</p> <p>enheter som har erkänts med avseende på kraven i direktiv 2003/87/EG (systemet för handel med utsläppsrätter) och som står för utsläppsminskningar motsvarande ett ton koldioxid (ton koldioxidekvivalenter – tCO₂e)</p> <p>RTS2#3 = EMAL och RTS2#11 = CERE</p>	150 000 ton koldioxidekvivalenter	5

Tillgångsklass – Utsläppsrätter		
Underklass till tillgångsklassen	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier	
	Genomsnittligt dagligt belopp (ADA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
Utsläppsminskningenheter (ERU) enheter som har erkänts med avseende på kraven i direktiv 2003/87/EG (systemet för handel med utsläppsrätter) och som står för utsläppsminskningar motsvarande ett ton koldioxid (ton koldioxidekvivalenter – tCO ₂ e) RTS2#3 = EMAL och RTS2#11 = ERUE	150 000 ton koldioxidekvivalenter	5
Övriga utsläppsrätter en utsläppsrätt som är en utsläppsrätt som erkänts med avseende på kraven i direktiv 2003/87/EG (systemet för handel med utsläppsrätter) och som inte är en EU-utsläppsrätt (EUA), en EU-utsläppsrätt för luftfart (EUAA), en certifierad utsläppsminskning (CER) eller en utsläppsminskningseenhet (ERU) RTS2#3 = EMAL och RTS2#11 = OTHR	samtliga övriga utsläppsrätter anses inte ha en likvid marknad	

(¹) Europaparlamentets och rådets direktiv 2003/87/EG av den 13 oktober 2003 om ett system för handel med utsläppsrätter för växthusgaser inom gemenskapen och om ändring av rådets direktiv 96/61/EG (EUT L 275, 25.10.2003, s. 32).

Tabell 12.2

Utsläppsrätter – tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser till tillgångsklasser som anses ha en likvid marknad

Tillgångsklass – Utsläppsrätter												
Underklass till tillgångsklassen	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för underklasser till tillgångsklasser som anses ha en likvid marknad										
		SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel		LIS efter handel		
		Handel – percentil		Lägsta tröskelvärde		Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	
EU-utsläppsrätter (EUA)	transaktioner som utförs för alla EU-utsläppsrätter (EUA)	S1	S2	S3	S4	40 000 ton koldioxidkvivalenter	70	50 000 ton koldioxidkvivalenter	80	90 000 ton koldioxidkvivalenter	90	100 000 ton koldioxidkvivalenter
		30	40	50	60							
EU-utsläppsrätter för luftfart (EUAA)	transaktioner som utförs för alla EU-utsläppsrätter för luftfart (EUAA)	S1	S2	S3	S4	20 000 ton koldioxidkvivalenter	70	25 000 ton koldioxidkvivalenter	80	40 000 ton koldioxidkvivalenter	90	50 000 ton koldioxidkvivalenter
		30	40	50	60							
Certifierade utsläppsminskningar (CER)	transaktioner som utförs för alla certifierade utsläppsminskningar (CER)	S1	S2	S3	S4	20 000 ton koldioxidkvivalenter	70	25 000 ton koldioxidkvivalenter	80	40 000 ton koldioxidkvivalenter	90	50 000 ton koldioxidkvivalenter
		30	40	50	60							
Utsläppsminskningenheter (ERU)	transaktioner som utförs på alla utsläppsminskningenheter (ERU)	S1	S2	S3	S4	20 000 ton koldioxidkvivalenter	70	25 000 ton koldioxidkvivalenter	80	40 000 ton koldioxidkvivalenter	90	50 000 ton koldioxidkvivalenter
		30	40	50	60							

▼B

Tabell 12.3

Utsläppsrätter – tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser till tillgångsklasser som inte anses ha en likvid marknad

Tillgångsklass – Utsläppsrätter				
Underklass till tillgångsklassen	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser som inte anses ha en likvid marknad			
	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
EU-utsläppsrätter (EUA)	40 000 ton koldioxidekvivalenter	50 000 ton koldioxidekvivalenter	90 000 ton koldioxidekvivalenter	100 000 ton koldioxidekvivalenter
EU-utsläppsrätter för luftfart (EUAA)	20 000 ton koldioxidekvivalenter	25 000 ton koldioxidekvivalenter	40 000 ton koldioxidekvivalenter	50 000 ton koldioxidekvivalenter
Certifierade utsläppsminskningar (CER)	20 000 ton koldioxidekvivalenter	25 000 ton koldioxidekvivalenter	40 000 ton koldioxidekvivalenter	50 000 ton koldioxidekvivalenter
Utsläppsminskningenheter (ERU)	20 000 ton koldioxidekvivalenter	25 000 ton koldioxidekvivalenter	40 000 ton koldioxidekvivalenter	50 000 ton koldioxidekvivalenter

13. Utsläppsrättsderivat

▼M3

Tabell 13.1

Utsläppsrättsderivat – klasser som inte har en likvid marknad

Tillgångsklass – Utsläppsrättsderivat		
Underklass till tillgångsklassen	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier	
	Genomsnittligt dagligt belopp (ADA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]
Utsläppsrättsderivat där det underliggande är av typen EU-utsläppsrätter (EUA) finansiella instrument avseende utsläppsrätter av typen EU-utsläppsrätter (EUA) enligt definitionen i avsnitt C.4 i bilaga I till direktiv 2014/65/EU RTS2#3 = DERV och RTS2#4 = EMAL och RTS2#43 = EUAE	150 000 ton koldioxidekvivalenter	5

		Tillgångsklass – Utsläppsderivat	
Underklass till tillgångsklassen	Det ska anses att en underklass inte har en likvid marknad enligt artiklarna 6 och 8.1 b om den inte uppfyller ett av eller samtliga följande tröskelvärden för kvantitativa likviditetskriterier		
	Genomsnittligt dagligt belopp (ADA) [kvantitativt likviditetskriterium 1]	Genomsnittligt dagligt antal transaktioner [kvantitativt likviditetskriterium 2]	
<p>Utsläppsderivat där det underliggande är av typen EU-utsläppsrätter för luftfart (EUAA)</p> <p>finansiella instrument avseende utsläppsrätter av typen EU-utsläppsrätter för luftfart (EUAA) enligt definitionen i avsnitt C.4 i bilaga I till direktiv 2014/65/EU</p> <p>RTS2#3 = DERV och RTS2#4 = EMAL och RTS2#43 = EUAA</p>	150 000 ton koldioxidekvivalenter	5	
<p>Utsläppsderivat där det underliggande är av typen certifierade utsläppsminskningar (CER)</p> <p>finansiella instrument avseende utsläppsrätter av typen certifierade utsläppsminskningar (CER) enligt definitionen i avsnitt C.4 i bilaga I till direktiv 2014/65/EU</p> <p>RTS2#3 = DERV och RTS2#4 = EMAL och RTS2#43 = CERE</p>	150 000 ton koldioxidekvivalenter	5	
<p>Utsläppsderivat där det underliggande är av typen utsläppsminskningenheter (ERU)</p> <p>finansiella instrument avseende utsläppsrätter av typen utsläppsminskningenheter (ERU) enligt definitionen i avsnitt C.4 i bilaga I till direktiv 2014/65/EU</p> <p>RTS2#3 = DERV och RTS2#4 = EMAL och RTS2#43 = ERUE</p>	150 000 ton koldioxidekvivalenter	5	
<p>Övriga utsläppsderivat</p> <p>utsläppsderivat där det underliggande inte är en utsläppsrätt som erkänts med avseende på kraven i direktiv 2003/87/EG (systemet för handel med utsläppsrätter) och som inte är en EU-utsläppsrätt (EUA), en EU-utsläppsrätt för luftfart (EUAA), en certifierad utsläppsminskning (CER) och en utsläppsminskningenshet (ERU)</p> <p>RTS2#3 = DERV och RTS2#4 = EMAL och RTS2#43 = OTHR</p>	samtliga övriga utsläppsderivat anses inte ha en likvid marknad		

Tabell 13.2

Utsläppsrättsderivat – tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser till tillgångsklasser som anses ha en likvid marknad

Tillgångsklass – Utsläppsrättsderivat												
Underklass till tillgångsklassen	Transaktioner som ska beaktas vid beräkningen av tröskelvärden	Percentiler och lägsta tröskelvärden som ska användas för beräkning av tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende SSTI och LIS för underklasser till tillgångsklasser som anses ha en likvid marknad										
		SSTI före handel				LIS före handel		SSTI efter handel		LIS efter handel		
		Handel – percentil		Lägsta tröskelvärde		Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	Handel – percentil	Lägsta tröskelvärde	
Utsläppsrättsderivat där det underliggande är av typen EU-utsläppsrätter (EUA)	transaktioner som utförs för alla utsläppsrättsderivat där det underliggande är av typen EU-utsläppsrätter (EUA)	S1	S2	S3	S4	40 000 ton koldioxidekvivalenter	70	50 000 ton koldioxidekvivalenter	80	90 000 ton koldioxidekvivalenter	90	100 000 ton koldioxidekvivalenter
		30	40	50	60							
Utsläppsrättsderivat där det underliggande är av typen EU-utsläppsrätter för luftfart (EUAA)	transaktioner som utförs för alla utsläppsrättsderivat där det underliggande är av typen EU-utsläppsrätter för luftfart (EUAA)	S1	S2	S3	S4	20 000 ton koldioxidekvivalenter	70	25 000 ton koldioxidekvivalenter	80	40 000 ton koldioxidekvivalenter	90	50 000 ton koldioxidekvivalenter
		30	40	50	60							
Utsläppsrättsderivat där det underliggande är av typen certifierade utsläppsminskningar (CER)	transaktioner som utförs för alla utsläppsrättsderivat där det underliggande är av typen certifierade utsläppsminskningar (CER)	S1	S2	S3	S4	20 000 ton koldioxidekvivalenter	70	25 000 ton koldioxidekvivalenter	80	40 000 ton koldioxidekvivalenter	90	50 000 ton koldioxidekvivalenter
		30	40	50	60							
Utsläppsrättsderivat där det underliggande är av typen utsläppsminskningenheter (ERU)	transaktioner som utförs för alla utsläppsrättsderivat där det underliggande är av typen utsläppsminskningenheter (ERU)	S1	S2	S3	S4	20 000 ton koldioxidekvivalenter	70	25 000 ton koldioxidekvivalenter	80	40 000 ton koldioxidekvivalenter	90	50 000 ton koldioxidekvivalenter
		30	40	50	60							

Tabell 13.3

Utsläppsrättsderivat – tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser till tillgångsklasser som inte anses ha en likvid marknad

Tillgångsklass – Utsläppsrättsderivat				
Underklass till tillgångsklassen	Tröskelvärden för transparens före och efter handel avseende storlek som är specifik för det finansiella instrumentet (SSTI) och order av större omfattning (LIS) för underklasser till tillgångsklasser som inte anses ha en likvid marknad			
	SSTI före handel	LIS före handel	SSTI efter handel	LIS efter handel
	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde	Tröskelvärde
Utsläppsrättsderivat där det underliggande är av typen EU-utsläppsrätter (EUA)	40 000 ton koldioxidekvivalenter	50 000 ton koldioxidekvivalenter	90 000 ton koldioxidekvivalenter	100 000 ton koldioxidekvivalenter
Utsläppsrättsderivat där det underliggande är av typen EU-utsläppsrätter för luftfart (EUAA)	20 000 ton koldioxidekvivalenter	25 000 ton koldioxidekvivalenter	40 000 ton koldioxidekvivalenter	50 000 ton koldioxidekvivalenter
Utsläppsrättsderivat där det underliggande är av typen certifierade utsläppsminskningar (CER)	20 000 ton koldioxidekvivalenter	25 000 ton koldioxidekvivalenter	40 000 ton koldioxidekvivalenter	50 000 ton koldioxidekvivalenter
Utsläppsrättsderivat där det underliggande är av typen utsläppsminskningenheter (ERU)	20 000 ton koldioxidekvivalenter	25 000 ton koldioxidekvivalenter	40 000 ton koldioxidekvivalenter	50 000 ton koldioxidekvivalenter
Övriga utsläppsrättsderivat	20 000 ton koldioxidekvivalenter	25 000 ton koldioxidekvivalenter	40 000 ton koldioxidekvivalenter	50 000 ton koldioxidekvivalenter

▼ B

BILAGA IV

Referensuppgifter som ska lämnas för transparensberäkningar

▼ M3▼ C1

Tabell 1

Symboltabell för tabell 2

BETECKNING	DATATYP	DEFINITIONER
{ALPHANUM-n}	Upp till n alfanumeriska tecken	Fritextfält
{DECIMAL-n/m}	Decimaltal med upp till n siffror, där upp till m siffror kan vara bråkdelar.	Numeriskt fält för både positiva och negativa värden: 1. Decimalseparator är ”.” (punkt) 2. Talet kan ha prefixet ”-” (minus) för att ange negativa tal Om tillämpligt ska värden avrundas och trunkeras inte
{COUNTRYCODE_2}	2 alfanumeriska tecken	Landskod med 2 tecken enligt ISO 3166-1 alfa-2 landskod
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumeriska tecken	Valutakod med 3 bokstäver enligt ISO 4217 valutakoder
{DATEFORMAT}	Datumformat enligt ISO 8601	Datum anges enligt följande format: ÅÅÅÅ-MM-DD
{ISIN}	12 alfanumeriska tecken	ISIN-kod enligt ISO 6166
{LEI}	20 alfanumeriska tecken	Identitetsbeteckning för juridisk person i enlighet med definitionen i ISO 17442
{MIC}	4 alfanumeriska tecken	Kod för marknadsidentifiering enligt ISO 10383
{EIC}	16 alfanumeriska tecken	en EIC-kod för ett leveransställe inom eller utanför Europeiska unionen
{INDEX}	4 alfabetiska tecken	”EONA” – EONIA ”EONS” – EONIA SWAP ”EURI” – EURIBOR ”EUUS” – EURODOLLAR ”EUCH” – EuroSwiss ”GCFR” – GCF REPO ”ISDA” – ISDAFIX ”LIBI” – LIBID ”LIBO” – LIBOR ”MAAA” – Muni AAA ”PFAN” – Pfandbriefe ”TIBO” – TIBOR ”STBO” – STIBOR ”BBSW” – BBSW ”JIBA” – JIBAR ”BUBO” – BUBOR ”CDOR” – CDOR

▼ C1

BETECKNING	DATATYP	DEFINITIONER
		”CIBO” – CIBOR ”MOSP” – MOSPRIM ”NIBO” – NIBOR ”PRBO” – PRIBOR ”TLBO” – TELBOR ”WIBO” – WIBOR ”TREA” – Treasury ”SWAP” – SWAP ”FUSW” – Future SWAP

▼ M3

Tabell 2

Närmare specificering av referensuppgifter som ska lämnas för transparensberäkningar

#	FÄLT	UPPGIFTER SOM SKA RAPPORTERAS IN	RAPPORTERINGSFORMAT
1	Instrumentets identifieringskod	Kod som används för att identifiera det finansiella instrumentet	{ISIN}
2	Instrumentets fullständiga namn	Fullständigt namn för det finansiella instrumentet	{ALPHANUM-350}
3	Identifieringskod enligt Mifir	<p>Identifiering av icke-aktierelaterade finansiella instrument:</p> <p>Värdepapperiserade derivat enligt definitionen i tabell 4.1 i avsnitt 4 i bilaga III</p> <p>Strukturerade finansiella produkter (SFP:er) enligt definitionen i artikel 2.1 28 i förordning (EU) nr 600/2014</p> <p>Obligationer (alla obligationer utom ETC:er och ETN:er) enligt definitionen i artikel 4.1 44 b i direktiv 2014/65/EU</p> <p>ETC:er enligt definitionen i artikel 4.1 44 b i direktiv 2014/65/EU och som specificeras ytterligare i avsnitt 2 tabell 2.4 i bilaga III</p> <p>ETN:er enligt definitionen i artikel 4.1 44 b i direktiv 2014/65/EU och som specificeras ytterligare i avsnitt 2 tabell 2.4 i bilaga III</p> <p>Utsläppsrätter enligt definitionen i avsnitt 12 tabell 12.1 i bilaga III</p> <p>Derivat enligt definitionen i avsnitt C 4–10 i bilaga I till direktiv 2014/65/EU</p>	<p>Icke-aktierelaterade finansiella instrument:</p> <p>”SDRV” – Värdepapperiserade derivat</p> <p>”SFPS” – Strukturerade finansiella produkter (SFP:er)</p> <p>”BOND” – Obligationer</p> <p>”ETCS” – ETC:er</p> <p>”ETNS” – ETN:er</p> <p>”EMAL” – Utsläppsrätter</p> <p>”DERV” – Derivat</p>

▼ M3

#	FÄLT	UPPGIFTER SOM SKA RAPPORTERAS IN	RAPPORTERINGSFORMAT
4	Underliggande tillgångsklass	Ska fyllas i när identifieringskoden enligt Mifir motsvarar värdepapperiserade derivat eller derivat	"INTR" – Ränta "EQUI" – Aktie "COMM" – Råvara "CRDT" – Kredit "CURR" – Valuta "EMAL" – Utsläppsätter "OCTN" – Övrigt C10
5	Typ av kontrakt	Ska fyllas i när identifieringskoden enligt Mifir motsvarar derivat	"OPTN" – Option "FUTR" – Future (inklusive – framtida fraktratskontrakt (FFA:er)) "FRAS" – Räntetermin (FRA) "FORW" – Forward "SWAP" – Swap "PSWP" – Portföljswap "SWPT" – Swaption "OPTS" – Option på en swap "FONS" – Future på en swap "FWOS" – Forward på en swap "SPDB" – Spread betting "CFDS" – CFD "OTHR" – Övrigt
6	Rapporteringsdag	Dag för vilken refersuppgifter lämnas	{DATEFORMAT}
7	Handelsplats	MIC för marknadssegment för handelsplatsen, om tillgängligt, annars operativ MIC	{MIC}
8	Löptid	Det finansiella instrumentets angivna löptid. Fältet gäller för tillgångsklasserna obligationer, räntederivat, aktiederivat, råvaruderivat, valutaderivat, kreditderivat, C10-derivat och utsläppsätterderivat	{DATEFORMAT}

Fält som rör obligationer (alla typer av obligationer utom ETC:er och ETN:er)

Fälten i detta avsnitt ska endast fyllas i för obligationer enligt definitionen i avsnitt 2 tabell 2.1 i bilaga III

9	Typ av obligation	Typ av obligation enligt vad som anges i avsnitt 2 tabell 2.2 i bilaga III. Fältet ska endast fyllas i när identifieringskoden enligt Mifir motsvarar obligationer.	"EUSB" – Statsobligation "OEPB" – Annan offentlig obligation "CVTB" – Konvertibel obligation "CVDB" – Säkerställd obligation
---	-------------------	---	---

▼ **M3**

			”CRPB” – Företagsobligation ”OTHR” – Övrigt
10	Utfärdandedatum	Dag då en obligation utfärdas och börjar ackumulera ränta	{DATEFORMAT}

Fält som rör utsläppsrätter

Fälten i detta avsnitt ska endast fyllas i för utsläppsrätter enligt definitionen i avsnitt 12 tabell 12.1 i bilaga III

11	Typ av utsläppsrätter	Utsläppsrätter	”CERE” – CER ”ERUE” – ERU ”EUAE” – EUA ”EUAA” – EUAA ”OTHR” – Övrigt
----	-----------------------	----------------	--

Fält som rör derivat**Råvaruderivat och C10 derivat**

Fälten i detta avsnitt ska endast fyllas i för råvaruderivat enligt definitionen i avsnitt 7 tabell 7.1 i bilaga III och för C10-derivat enligt definitionen i avsnitt 10 tabell 10.1 i bilaga III.

12	Specificering av storlek avseende underkategori av fraktslag	Ska fyllas i när basprodukten enligt fält 35 i tabell 2 i bilagan till delegerade förordning (EU) 2017/585 är transport	För torrlast: ”CAPE” — Capesize ”PNMX” — Panamax ”SPMX” — Supramax ”HAND” — Handysize För våtlast: ”CLAN” — Clean ”DRTY” — Dirty {ALPHANUM-4} i annat fall
13	Medelvärde för specifik rutt eller tidsbefraktning	Ska fyllas i när basprodukten enligt fält 35 i tabell 2 i bilagan till delegerade förordning (EU) 2017/585 är transport	För våtlast: ”TD7” — TD7 ”TD8” — TD8 ”TD17” — TD17 ”TD19” — TD19 ”TD20” — TD20 ”BLPG1” — BLPG1 ”TD3C” — TD3C ”TC2” — TC2 ”TC2_37” — TC2_37 ”TD3” — TD3 ”TC5” — TC5 ”TC6” — TC6 ”TC7” — TC7 ”TC9” — TC9 ”TC12” — TC12 ”TC14” — TC14 ”TC15” — TC15

▼ M3

			<p>För torrlast:</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} i annat fall</p>
14	Leverans/plats för kontant avveckling	Ska fyllas i när basprodukten enligt fält 35 i tabell 2 i bilagan till delegerade förordning (EU) 2017/585 är energi	{EIC} för el eller naturgas "OTHR" – Övrigt
15	Teoretisk valuta	Valuta som beloppet är denominerat i	{CURRENCYCODE_3}

Räntederivat

Fälten i detta avsnitt ska endast fyllas i för räntederivat enligt definitionen i avsnitt 5 tabell 5.1 i bilaga III

16	Typ av underliggande	<p>Fylls i för kontrakt som inte är swappar, swaptioner, futures på en swap eller forwards på en swap, med något av följande alternativ</p> <p>*****_*****</p> <p>Fylls i för kontrakt som är swappar, swaptioner, optioner på en swap, futures på en swap eller forwards på en swap, med något av följande alternativ</p>	<p>"BNDF" – Obligationsfuture</p> <p>"BNDF" – Obligationsfutures "INTR" – Ränta</p> <p>"IFUT" – Ränfefutures</p> <p>*****</p> <p>"FFMC" – valutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (multi-currency swaps) för rörlig kontra rörlig ränta (float-to-float)</p> <p>"XFMC" – valutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (multi-currency swaps) för fast kontra rörlig ränta (fixed-to-float)</p> <p>"XXMC" – valutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (multi-currency swaps) för fast kontra fast ränta (fixed-to-fixed)</p> <p>"OSMC" – OIS-kontrakt vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (OIS multi-currency swaps)</p> <p>"IFMC" – inflationsvalutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (inflation multi-currency swaps)</p> <p>"FFSC" – valutaswappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (single-currency swaps) för rörlig kontra rörlig ränta (float-to-float)</p> <p>"XFSC" – valutaswappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (single-currency swaps) för fast kontra rörlig ränta (fixed-to-float)</p>
----	----------------------	--	--

▼ M3

			<p>”XXSC” – swappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (single-currency swaps) för fast kontra fast ränta (fixed-to-fixed)</p> <p>”OSSC” – OIS-kontrakt vars komponenter är denominerade i samma valuta (OIS single-currency swaps)</p> <p>”IFSC” – inflationsswappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (inflation single-currency swap)</p>
17	Emittent av den underliggande obligationen	Ska fyllas i när typen av underliggande är en obligation eller en obligationsfuture, med identifieringskoden för juridiska personer (LEI) för emittenten av den direkta eller yttersta underliggande obligationen	{LEI}
18	Förfalldag för den underliggande obligationen	Ska fyllas i med förfalldagen för den underliggande obligationen.	{DATEFORMAT}
19	Utfärdandedatum för den underliggande obligationen	Ska fyllas i med utfärdandedatum för den underliggande obligationen.	{DATEFORMAT}
20	Teoretisk valuta för swaptionen	Ska endast fyllas i för swaptioner	{CURRENCYCODE_3}
21	Förfalldag för den underliggande swappen	Ska endast fyllas i för swaptioner, optioner på swappar, futures på en swap och forwards på en swap.	{DATEFORMAT}
22	ISIN-kod för inflationsindex / ISIN-kod för underliggande obligation	<p>För swaptioner med en av följande underliggande typ av swappar: inflationsvalutaswappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (inflation single currency swaps) och terminer (futures/forwards) på dessa, och valutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (multi-currency swaps) och terminer (futures/forwards) på dessa, måste, om inflationsindexet har en ISIN-kod, fältet fyllas i med den koden</p> <p>*****_ *****</p> <p>För obligationsoptioner / optioner på en obligationsoption / optioner på en obligationsfuture måste fältet fyllas i med ISIN-koden för den yttersta underliggande obligationen.</p>	<p>{ISIN}</p> <p>*****</p> <p>{ISIN}</p>

▼ M3

23	Namn på inflations-index	Ska fyllas i med indexets standardiserade namn om det rör sig om swapoptioner med en av följande underliggande typ av swappar: inflationsvalutaswappar vars komponenter är denominerade i samma valuta (inflation single currency swaps) och terminer (futures/forwards) på dessa, och valutaswappar vars komponenter är denominerade i flera olika valutor (multi-currency swaps) och terminer (futures/forwards) på dessa.	{ALPHANUM-25}
24	Referensränta	Namn på referensräntan	{INDEX} eller {ALPHANUM-25}- om referensräntan inte finns i förteckningen {INDEX}
25	löptid för underliggande räntesats	Här anges löptiden för den underliggande räntesatsen för kontraktet. Löptiden ska uttryckas i dagar, veckor, månader eller år. Standardlöptiden ska anges i detta fält, varvid den största löptidsenheten (år) ska anges först följt av de lägre i turordning, räntesatsens löptid är ett heltal.	{INTEGER-3}+"DAYS" – dagar {INTEGER-3}+"WEEK" – veckor {INTEGER-3}+"Mnth" – månader {INTEGER-3}+"YEAR" – år

Valutaderivat

Fälten i detta avsnitt ska endast fyllas i för valutaderivat enligt definitionen i avsnitt 8 tabell 8.1 i bilaga III

26	Underkategori av kontrakt	Ska fyllas i för att särskilja levererbara och icke-levererbara forwards, optioner och swappar enligt definitionen i avsnitt 8 tabell 8.1 i bilaga III	"DLVB" – levererbar "NDLV" – ej levererbar
----	---------------------------	--	---

Aktiederivat

Fälten ska endast fyllas i för aktiederivat enligt definitionen i avsnitt 6 tabell 6.1 i bilaga III

27	Typ av underliggande	Ska fyllas i när identifieringskoden enligt Mifir motsvarar derivat, tillgångsklassen för det underliggande är aktier och underklassen till tillgångsklassen varken är swappar eller portföljswappar	"STIX" – Aktieindex "SHRS" – Aktie "DIVI" – Utdelningsindex "DVSE" – Aktieutdelning "BSKT" – Korg av aktier som är ett resultat av en bolagshändelse "ETFS" – ETF (börshandlade fonder) "VOLI" – Volatilitetsindex "OTHR" – Övrigt (däribland depåbevis, certifikat och andra aktieliknande finansiella instrument)
----	----------------------	--	---

▼ M3

		<p>*****_ *****</p> <p>Ska fyllas i när identifieringskoden enligt Mifir motsvarar derivat, tillgångsklassen för det underliggande är aktier, underklassen till tillgångsklassen är antingen swappar eller portföljswappar och uppdelningskriterium 2 enligt avsnitt 6 tabell 6.1 i bilaga III är ett namn</p>	<p>*****</p> <p>”SHRS” – Aktie ”DVSE” – Aktieutdelning ”ETFS” – ETF:er (börshandlade fonder) ”OTHR” – Övrigt (däribland depåbevis, certifikat och andra aktieliknande finansiella instrument)</p>
		<p>*****_ *****</p> <p>Ska fyllas i när identifieringskoden enligt Mifir motsvarar derivat, tillgångsklassen för det underliggande är aktier, underklassen till tillgångsklassen är antingen swappar eller portföljswappar och uppdelningskriterium 2 enligt avsnitt 6 tabell 6.1 i bilaga III är ett index</p>	<p>*****</p> <p>”STIX” – Aktieindex ”DIVI” – Utdelningsindex ”VOLI” – Volatilitetsindex ”OTHR” – Övrigt</p>
		<p>*****_ *****</p> <p>Ska fyllas i när identifieringskoden enligt Mifir motsvarar derivat, tillgångsklassen för det underliggande är aktier, underklassen till tillgångsklassen är antingen swappar eller portföljswappar och uppdelningskriterium 2 enligt avsnitt 6 tabell 6.1 i bilaga III är en korg</p>	<p>*****</p> <p>”BSKT” – Korg</p>
28	Parameter	<p>Ska fyllas i när identifieringskoden enligt Mifir motsvarar derivat, tillgångsklassen för det underliggande är aktier och underklassen till tillgångsklassen är antingen swappar eller portföljswappar</p>	<p>”PRBP” – ”Price return basic performance parameter” ”PRDV” – ”Parameter return dividend” ”PRVA” – ”Parameter return variance” ”PRVO” – ”Parameter return volatility”</p>

Kontrakt avseende prisdifferenser (CFD:er)

Fälten ska endast fyllas i när typen av kontrakt är CFD eller spread betting

29	Typ av underliggande	<p>Ska fyllas i när identifieringskoden enligt Mifir motsvarar derivat och typen av kontrakt är CFD eller spread betting</p>	<p>”CURR” – Valuta ”EQUI” – Aktie ”BOND” – Obligationer ”FTEQ” – Futures/Forward på en aktie ”OPEQ” – Option på en aktie ”COMM” – Råvara ”EMAL” – Utsläppsrätter ”OTHR” – Övrigt</p>
----	----------------------	--	--

▼ M3

30	Teoretisk valuta 1	Valuta 1 i det underliggande valutaparet. Fältet gäller bara om typen av underliggande är valuta	{CURRENCYCODE_3}
31	Teoretisk valuta 2	Valuta 2 i det underliggande valutaparet. Fältet gäller bara om typen av underliggande är valuta	{CURRENCYCODE_3}

Kreditderivat

Fälten i detta avsnitt ska endast fyllas i för kreditderivat enligt definitionen i avsnitt 9 tabell 9.1 i bilaga III

32	ISIN-kod för underliggande creditswap	Ska fyllas i för derivat baserade på en creditswap med ISIN-koden för underliggande swap	{ISIN}
33	Kod för underliggande index	Ska fyllas i för kreditindexderivat med ISIN-koden för indexet	{ISIN}
34	Namn på underliggande index	Ska fyllas i för kreditindexderivat med indexets standardiserade namn	{ALPHANUM-25}
35	Serier	Serienummer för indexets sammansättning, om tillämpligt Ska fyllas i för kreditindex eller kreditindexderivat med indexets serienummer	{DECIMAL-18/17}
36	Version	En ny version av en serie utfärdas vid fallissemang för en av de ingående delarna och indexet måste viktas om för att ta hänsyn till det nya antalet totala ingående delar i indexet Ska fyllas i för kreditindex eller kreditindexderivat med indexets version	{DECIMAL-18/17}
37	Byte mellan närliggande löptider	Alla månader när byte mellan närliggande löptider förväntas enligt vad som fastställs av indexets tillhandahållare för ett visst år. Fältet fylls i för varje månad för byte mellan närliggande löptider Ska fyllas i för kreditindex eller kreditindexderivat	"01", "02", "03", "04", "05", "06", "07", "08", "09", "10", "11", "12"
38	Nästa datum för byte mellan närliggande löptider	Ska fyllas i för kreditindex eller kreditindexderivat med nästa datum för byte mellan närliggande löptider enligt vad som fastställs av indexets tillhandahållare	{DATEFORMAT}
39	Emittent av typen statlig och offentlig	Ska fyllas i när referensenheten för creditswappar som refererar till ett namn eller ett derivat som baserar sig på creditswappar som refererar till ett namn är en statlig emittent enligt definitionen i avsnitt 9 tabell 9.1 i bilaga III	"TRUE" – Referensenheten är en emittent av typen statlig och offentlig "FALSE" – Referensenheten är inte en emittent av typen statlig och offentlig

▼ **M3**

40	Referensobligation	Ska fyllas i för derivat baserade på en kreditswap som refererar till ett namn med ISIN-koden för referensobligationen	{ISIN}
41	Referensenhet	Ska fyllas i med referensenheten för kreditwappar som refererar till ett namn eller derivat som baserar sig på kreditwappar som refererar till ett namn	{COUNTRYCODE_2} eller ISO 3166-2 – Landskod med 2 tecken, följt av ett bindestreck ”-” och kod för distrikt med upp till 3 alfanumeriska tecken eller {LEI}
42	Teoretisk valuta	Valuta som beloppet är denominerat i	{CURRENCYCODE_3}

Utsläppsderivat

Fälten i detta avsnitt ska endast fyllas i för utsläppsderivat enligt definitionen i avsnitt 13 tabell 13.1 i bilaga III

43	Typ av utsläppsderivat	Ska fyllas i om variabel 3 ”Identifieringskod enligt Mifir” är ”DERV” – derivat, och variabel 4 ”Underliggande tillgångsklass” är ”EMAL” – utsläppsderivat	”CERE” – CER ”ERUE” – ERU ”EUAE” – EUA ”EUAA” – EUAA ”OTHR” – Övrigt
----	------------------------	--	--

▼ M3

BILAGA V

Kvantitativa data som ska lämnas för transparensberäkningar

Tabell 1

Symboltabell för tabell 2

Symbol	Datatyp	Definition
{ALPHANUM-n}	Upp till n alfanumeriska tecken	Fritextfält
{ISIN}	12 alfanumeriska tecken	ISIN-kod enligt ISO 6166
{MIC}	4 alfanumeriska tecken	Kod för marknadsidentifiering enligt ISO 10383
{DATEFORMAT}	Datumformat enligt ISO 8601	Datum anges enligt följande format: ÅÅÅÅ-MM-DD
{DECIMAL-n/m}	Decimaltal med upp till n siffror totalt där upp till m siffror kan vara bråkdelar	Numeriskt fält för både positiva och negativa värden. Decimaltecknet är ”.” (punkt) Negativa siffror föregås av ”-” (minus) Värden avrundas och trunkeas inte.
{INTEGER-n}	Heltal med upp till n siffror	Numeriskt fält för både positiva och negativa heltalsvärden:

Tabell 2

Närmare specificering om de uppgifter som ska lämnas för att fastställa en likvid marknad och LIS- och SSTI-tröskelvärdena för icke-aktierelaterade finansiella instrument

#	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in	Typ av genomförande/ offentliggörande	Format och standarder för rapportering
1	Instrumentets identifieringskod	Kod som används för att identifiera det finansiella instrumentet	Reglerad marknad (RM) Multilateral handelsplattform (MTF) Organiserad handelsplattform (OTF) Godkänt publiceringsarrangemang (APA) Tillhandahållare av konsoliderad handelsinformation (CTP)	{ISIN}
2	Datum för genomförande	Datum då transaktionerna genomförs.	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DATEFORMAT}

▼ M3

#	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in	Typ av genomförande/ offentliggörande	Format och standarder för rapportering
3	Handelsplats	<p>Segment-MIC-kod för handelsplats eller systematisk internhandlare i EU om sådan finns, i annat fall den operativa MIC-koden.</p> <p>MIC för marknadssegment för handelsplatsen, om tillgängligt, annars operativ MIC</p> <p>MIC-koden XOFF för OTC-transaktioner.</p> <p>För en viss ISIN-kod och genomförandedatum ska APA summera all OTC-handelsverksamhet för det instrumentet i en enda post (ISIN, XOFF, datum för genomförande).</p>	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{MIC} för handelsplatsen eller den systematiska internhandlaren, eller "XOFF"
4	Flagga för instrument som stoppats från handel	<p>Uppgift om huruvida handel med instrumentet stoppades hela handelsdagen på respektive handelsplats på genomförandedagen.</p> <p>Följaktligen ska ett värde på noll rapporteras i fält 5.</p>	RM, MTF, OTF	"TRUE" – om instrumentet tillfälligt stoppades för hela handelsdagen eller "FALSE" – om instrumentet inte var tillfälligt stoppat under hela handelsdagen.
5	Totalt antal transaktioner	<p>Det totala antalet transaktioner som utförts på genomförandedatumet.</p> <p>Transaktioner som har annullerats ska undantas från de rapporterade siffrorna.</p> <p>Transaktioner som omfattas av uppskjutet offentliggörande ska räknas i de sammanlagda siffror som tillhandahålls av de rapportinlämnande enheterna på grundval av genomförandedatumet.</p> <p>I samtliga fall måste fältet fyllas i med ett värde som är större än eller lika med noll.</p> <p>För instrument som skjutits upp för hela dagen ska fältet ha värdet noll.</p>	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
6	Total volym	<p>Den totala volym som genomförts på genomförandedatumet.</p> <p>Volymen ska mätas i enlighet med tabell 4 i bilaga II till denna förordning.</p> <p>Penningbelopp ska rapporteras i euro.</p> <p>Transaktioner som har annullerats ska undantas från de rapporterade siffrorna.</p> <p>Transaktioner som omfattas av uppskjutet offentliggörande ska räknas i de sammanlagda siffror som tillhandahålls av de rapportinlämnande enheterna på grundval av genomförandedatumet.</p>	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

▼ M3

#	Fält	Uppgifter som ska rapporteras in	Typ av genomförande/ offentliggörande	Format och standarder för rapportering
7	”Transaktionsstorlek”-klassens intervall	<p>Detta fält ska fyllas i med de värden som anges i tabellerna 3 och 4 i denna bilaga.</p> <p>Transaktionsstorleksklassens intervall definieras enligt följande:</p> <p>I tabell 4 i denna bilaga för utsläppsätter och derivat av dessa.</p> <p>I tabell 3 i denna bilaga för övriga instrument.</p> <p>För instrument som skjutits upp för hela dagen ska uppgifter som rör detta fält och fälten 8 och 9 inte rapporteras.</p>	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{ALPHANUM--140}
8	Det totala antalet transaktioner som genomförs för den klassen	<p>Det totala antal transaktioner som genomförs på genomförandedatumet och vars storlek ligger inom klassens intervall.</p> <p>Transaktioner som har annullerats ska undantas från de rapporterade siffrorna.</p> <p>Transaktioner som omfattas av uppskjutet offentliggörande ska räknas i de sammanlagda siffror som tillhandahålls av de rapportinlämnande enheterna på grundval av genomförandedatumet.</p>	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{INTEGER-18}
9	Total handelsvolym för den klassen	<p>Den totala handlade volymen som utgörs av alla transaktioner som genomförs på rapporteringsdagen och vars storlek ligger inom klassens intervall.</p> <p>Volymen ska mätas i enlighet med tabell 4 i bilaga II till denna förordning.</p> <p>Penningbelopp ska rapporteras i euro.</p> <p>Transaktioner som har annullerats ska undantas från de rapporterade siffrorna.</p> <p>Transaktioner som omfattas av uppskjutet offentliggörande ska räknas i de sammanlagda siffror som tillhandahålls av de rapportinlämnande enheterna på grundval av genomförandedatumet.</p>	RM, MTF, OTF, APA, CTP	{DECIMAL-18/5}

▼ M3

Tabell 3

Handelsstorleksklasser för obligationer, SFP:er, värdepapperiserade derivat, räntederivat, aktiederivat, valutaderivat, kreditderivat, råvaruderivat, C10-derivat och CFD:er

Tillämpningsområde	Transaktionsstorleksklass	Definition
Transaktioner med en storlek på mellan 0 och 100,000,000 euro (exklusive).]0 – 100,000[Transaktioner med en handelsstorlek på mindre än 100,000 euro.
	[100,000 – 100,000]	Transaktioner med en handelsstorlek lika med 100,000 EUR.
]100,000 – 200,000[Transaktioner med en handelsstorlek på mer än 100,000 EUR men mindre än 200,000 EUR.
	[200,000 – 300,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 200,000 EUR eller mer men minde än 300,000 EUR.
	[300,000 – 400,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 300,000 EUR eller mer men mindre än 400,000 EUR.
	[Y- Y + 100,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 300,000 EUR eller mer men mindre än Y EUR + 100,000 (steg om 100,000 EUR)
	[900,000 – 1,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 900,000 EUR eller mer men mindre än 1,000,000 EUR.
Transaktioner med en storlek på mellan 1,000,000 EUR (inklusive) och 10,000,000 EUR (exklusive)	[1,000,000 – 1,500,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 1,000,000 EUR eller mer men mindre än 1,500,000 EUR.
	[1,500,000 – 2,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 1,500,000 EUR eller mer men mindre än 2,000,000 EUR
	[Z- Z + 500,000[Transaktioner med en handelsstorlek på Z EUR eller mer men mindre än Z EUR + 500,000 (steg om 500,000 EUR)
	[9,500,000 – 10,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 9,500,000 EUR eller mer men mindre än 10,000,000 EUR
Transaktioner med en storlek på mellan 10,000,000 EUR (inklusive) och 100,000,000 EUR (exklusive)	[10,000,000 – 15,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 10,000,000 EUR eller mer men mindre än 15,000,000 EUR
	[15,000,000 – 20,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 15,000,000 EUR eller mer men mindre än 20,000,000 EUR
	[W- W + 5,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på W EUR eller mer men mindre än W EUR + 5,000,000 (steg om 5,000,000 EUR)
	[95,000,000 – 100,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 95,000,000 EUR eller mer men mindre än 100,000,000 EUR
Transaktioner med en storlek på 100,000,000 EUR eller mer	[100,000,000 – 125,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 100,000,000 EUR eller mer men mindre än 125,000,000 EUR
	[125,000,000 – 150,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 125,000,000 EUR eller mer men mindre än 150,000,000 EUR
	[X- X + 25,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på X EUR eller mer men mindre än X EUR + 25,000,000 (steg om 25,000,000 EUR)
...

▼ M3

Tabell 4

Transaktionsstorleksklassens intervall för utsläppsrätter och utsläppsrätsderivat

Omfång	Transaktionsstorleksklass	Definition
Transaktioner med en storlek på mellan 0 och 100,000,000 (exklusive).]0 – 100,000[Transaktioner med en handelsstorlek på mindre än 100,000 ton koldioxidkvivalenter (tCO ₂ e)
	[100,000 – 100,000]	Transaktioner med en handelsstorlek lika med 100,000 tCO ₂ e
]100,000 – 200,000[Transaktioner med en handelsstorlek på mer än 100,000 tCO ₂ e men mindre än 200,000 tCO ₂ e
	[200,000 – 300,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 200,000 tCO ₂ e eller mer men mindre än 300,000 tCO ₂ e
	[300,000 – 400,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 300,000 tCO ₂ e eller mer men mindre än 400,000 tCO ₂ e
	[Y- Y + 100,000[Transaktioner med en handelsstorlek på Y tCO ₂ e eller mer men mindre än Y tCO ₂ e + 100,000 (steg om 100,000 tCO ₂ e)
	[900,000 – 1,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 900,000 tCO ₂ e eller mer men mindre än 1,000,000 tCO ₂ e
Transaktioner med en storlek på mellan 1,000,000 (inklusive) och 10,000,000 (exklusive)	[1,000,000 – 1,500,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 1,000,000 tCO ₂ e eller mer men mindre än 1,500,000 tCO ₂ e
	[1,500,000 – 2,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 1,500,000 tCO ₂ e eller mer men mindre än 2,000,000 tCO ₂ e
	[Z- Z + 500,000[Transaktioner med en handelsstorlek på Z tCO ₂ e eller mer men mindre än Z tCO ₂ e + 500,000 (steg om 500,000 tCO ₂ e)
	[9,500,000 – 10,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 9,500,000 tCO ₂ e eller mer men mindre än 10,000,000 tCO ₂ e
Transaktioner med en storlek på mellan 10,000,000 (inklusive) och 100,000,000 (exklusive)	[10,000,000 – 15,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 10,000,000 tCO ₂ e eller mer men mindre än 15,000,000 tCO ₂ e
	[15,000,000 – 20,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 15,000,000 tCO ₂ e eller mer men mindre än 20,000,000 tCO ₂ e
	[W- W + 5,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på W tCO ₂ e eller mer men mindre än W tCO ₂ e + 5,000,000 (steg om 5,000,000 tCO ₂ e)
	[95,000,000 – 100,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 95,000,000 tCO ₂ e eller mer men mindre än 100,000,000 tCO ₂ e

▼ **M3**

Omfång	Transaktionsstorleksklass	Definition
Transaktioner med en storlek på 100,000,000 EUR eller mer	[100,000,000 – 125,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 100,000,000 tCO ₂ e eller mer men mindre än 125,000,000 tCO ₂ e
	[125,000,000 – 150,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på 125,000,000 tCO ₂ e eller mer men mindre än 150,000,000 tCO ₂ e
	[X- X + 25,000,000[Transaktioner med en handelsstorlek på X tCO ₂ e eller mer men mindre än X tCO ₂ e +25,000,000 (steg om 25,000,000 tCO ₂ e)
...