



Съвет на
Европейския съюз

Брюксел, 9 февруари 2022 г.
(OR. en)

6116/22
ADD 1

EF 44
ECOFIN 108
DELECT 21

ПРИДРУЖИТЕЛНО ПИСМО

От: Генералния секретар на Европейската комисия, подписано от г-жа Martine DEPREZ, директор

Дата на получаване: 8 февруари 2022 г.

До: Г-н Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, генерален секретар на Съвета на Европейския съюз

№ док. Ком.: C(2022) 619 final ANNEX

Относно: ПРИЛОЖЕНИЕ към ДЕЛЕГИРАН РЕГЛАМЕНТ (ЕС) НА КОМИСИЯТА за изменение на регулаторните технически стандарти, определени в Делегиран регламент (ЕС) 2015/2205, във връзка с преминаването към нови бенчмаркове, с които са обвързани някои договори за извънборсови деривати

Приложено се изпраща на делегациите документ C(2022) 619 final ANNEX.

Приложение: C(2022) 619 final ANNEX



Брюксел, 8.2.2022 г.
C(2022) 619 final

ANNEX

ПРИЛОЖЕНИЕ

към

ДЕЛЕГИРАН РЕГЛАМЕНТ (ЕС) НА КОМИСИЯТА

за изменение на регулаторните технически стандарти, определени в Делегиран регламент (ЕС) 2015/2205, във връзка с преминаването към нови бенчмаркове, с които са обвързани някои договори за извънборсови деривати

ПРИЛОЖЕНИЕ

„ПРИЛОЖЕНИЕ

Класове лихвени извънборсови деривати, които са предмет на задължението за клиринг

Таблица 1

Класове базови суапове

| Номер | Вид | Референтен индекс | Валута на сепълмента | Срок до падежа | Вид валута на сепълмента | Опция | Вид условна стойност |
|-------|-------|-------------------|----------------------|----------------|--------------------------|-------|--------------------------|
| A.1.1 | Basis | Euribor | EUR | 28Д-50Г | Една валута | Не | Постоянна или променлива |

Таблица 2

Класове лихвени суапове с фиксирана срещу променлива лихва (fixed-to-float)

| Номер | Вид | Референтен индекс | Валута на сепълмента | Срок до падежа | Вид валута на сепълмента | Опция | Вид условна стойност |
|-------|----------------|-------------------|----------------------|----------------|--------------------------|-------|--------------------------|
| A.2.1 | Fixed-to-Float | Euribor | EUR | 28Д-50Г | Една валута | Не | Постоянна или променлива |

Таблица 3

Класове споразумения за лихвен форуърд

| Номер | Вид | Референтен индекс | Валута на сепълмента | Срок до падежа | Вид валута на сепълмента | Опция | Вид условна стойност |
|-------|-----|-------------------|----------------------|----------------|--------------------------|-------|--------------------------|
| A.3.1 | FRA | Euribor | EUR | 3Д-3Г | Една валута | Не | Постоянна или променлива |

Таблица 4

Класове овърнайт индекс суапове

| Номер | Вид | Референтен индекс | Валута на сепълмента | Срок до падежа | Вид валута на сепълмента | Опция | Вид условна стойност |
|-------|-----|-------------------|----------------------|----------------|--------------------------|-------|--------------------------|
| A.4.2 | OIS | FedFunds | USD | 7Д-3Г | Една валута | Не | Постоянна или променлива |
| D.4.1 | OIS | €STR | EUR | 7Д-3Г | Една валута | Не | Постоянна или променлива |
| D.4.2 | OIS | SONIA | GBP | 7Д-50Г | Една валута | Не | Постоянна или |

| | | | | | | | |
|-------|-----|------|-----|-------|-------------|----|--------------------------------|
| | | | | | | | променлива |
| D.4.3 | OIS | SOFR | USD | 7Д-3Г | Една валута | Не | Постоянна или променлива |