



Rada
Evropské unie

Brusel 9. února 2022
(OR. en)

6116/22
ADD 1

EF 44
ECOFIN 108
DELECT 21

PRŮVODNÍ POZNÁMKA

Odesílatel:	Martine DEPREZOVÁ, ředitelka, za generální tajemnici Evropské komise
Datum přijetí:	8. února 2022
Příjemce:	Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, generální tajemník Rady Evropské unie

Č. dok. Komise:	C(2022) 619 final ANNEX
Předmět:	PŘÍLOHA NAŘÍZENÍ KOMISE V PŘENESENÉ PRAVOMOCI (EU), kterým se mění regulační technické normy stanovené v nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2015/2205, pokud jde o přechod na nové referenční hodnoty, na něž se odkazuje v některých OTC derivátových smlouvách

Delegace naleznou v příloze dokument C(2022) 619 final ANNEX.

Příloha: C(2022) 619 final ANNEX



V Bruselu dne 8.2.2022
C(2022) 619 final

ANNEX

PŘÍLOHA

NAŘÍZENÍ KOMISE V PŘENESENÉ PRÁVOMOCI (EU),

kterým se mění regulační technické normy stanovené v nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2015/2205, pokud jde o přechod na nové referenční hodnoty, na něž se odkazuje v některých OTC derivátových smlouvách

PŘÍLOHA
„PŘÍLOHA

Kategorie OTC úrokových derivátů, které podléhají povinnosti clearingů

Tabulka 1

Kategorie bazických swapů

id	Druh	Referenční sazba	Vypořádací měna	Splatnost	Typ vypořádací měny	S opcí	Typ nominální hodnoty
A.1.1	Bazický	EURIBOR	EUR	28D–50R	Jedna měna	Ne	Konstantní nebo variabilní

Tabulka 2

Kategorie kuponových swapů

id	Druh	Referenční sazba	Vypořádací měna	Splatnost	Typ vypořádací měny	S opcí	Typ nominální hodnoty
A.2.1	Kuponový	EURIBOR	EUR	28D–50R	Jedna měna	Ne	Konstantní nebo variabilní

Tabulka 3

Kategorie dohod o budoucí úrokové míře

id	Druh	Referenční sazba	Vypořádací měna	Splatnost	Typ vypořádací měny	S opcí	Typ nominální hodnoty
A.3.1	FRA	EURIBOR	EUR	3D–3R	Jedna měna	Ne	Konstantní nebo variabilní

Tabulka 4

Kategorie swapů s jednodenní sazbou („overnight index swap“)

id	Druh	Referenční sazba	Vypořádací měna	Splatnost	Typ vypořádací měny	S opcí	Typ nominální hodnoty
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7D–3R	Jedna měna	Ne	Konstantní nebo variabilní
D.4.1	OIS	€STR	EUR	7D–3R	Jedna měna	Ne	Konstantní nebo variabilní
D.4.2	OIS	SONIA	GBP	7D–50R	Jedna měna	Ne	Konstantní nebo

							variabilní
D.4.3	OIS	SOFR	USD	7D-3R	Jedna měna	Ne	Konstantní nebo variabilní

“