



Συμβούλιο
της Ευρωπαϊκής Ένωσης

Βρυξέλλες, 9 Φεβρουαρίου 2022
(OR. en)

6116/22
ADD 1

EF 44
ECOFIN 108
DELECT 21

ΔΙΑΒΙΒΑΣΤΙΚΟ ΣΗΜΕΙΩΜΑ

Αποστολέας:	Για τη Γενική Γραμματέα της Ευρωπαϊκής Επιτροπής, η κα Martine DEPREZ, Διευθύντρια
Ημερομηνία Παραλαβής:	8 Φεβρουαρίου 2022
Αποδέκτης:	κ. Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Γενικός Γραμματέας του Συμβουλίου της Ευρωπαϊκής Ένωσης
Αριθ. εγγρ. Επιτρ.:	C(2022) 619 final - ANNEX
Θέμα:	ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ του ΚΑΤ' ΕΞΟΥΣΙΟΔΟΤΗΣΗ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (ΕΕ) ΤΗΣ ΕΠΙΤΡΟΠΗΣ για την τροποποίηση των ρυθμιστικών τεχνικών προτύπων που προβλέπονται στον κατ' εξουσιοδότηση κανονισμό (ΕΕ) 2015/2205 όσον αφορά τη μετάβαση σε νέους δείκτες αναφοράς που αναφέρονται σε ορισμένες συμβάσεις εξωχρηματοπιστηριακών παραγώγων

Διαβιβάζεται συνημμένως στις αντιπροσωπίες το έγγραφο - C(2022) 619 final - ANNEX.

σνημμ.: C(2022) 619 final - ANNEX



Βρυξέλλες, 8.2.2022
C(2022) 619 final

ANNEX

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ

του

ΚΑΤ' ΕΞΟΥΣΙΟΔΟΤΗΣΗ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ (ΕΕ) ΤΗΣ ΕΠΙΤΡΟΠΗΣ

για την τροποποίηση των ρυθμιστικών τεχνικών προτύπων που προβλέπονται στον κατ' εξουσιοδότηση κανονισμό (ΕΕ) 2015/2205 όσον αφορά τη μετάβαση σε νέους δείκτες αναφοράς που αναφέρονται σε ορισμένες συμβάσεις εξωχρηματιστηριακών παραγώγων

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ

«ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ

Κατηγορίες εξωχρηματιστηριακών παραγώγων επιτοκίων που υπόκεινται στην υποχρέωση εκκαθάρισης

Πίνακας 1

Κατηγορίες βασικών συμφωνιών ανταλλαγής

Αριθμός	Τύπος	Δείκτης Αναφοράς	Νόμισμα εκκαθάρισης	Ληκτότητα	Τύπος νομίσματος εκκαθάρισης	Δυνατότητα επιλογής	Τύπος ονομαστικής αξίας
A.1.1	Βασικός	Euribor	EUR	28H-50E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερή ή μεταβλητή

Πίνακας 2

Κατηγορίες συμφωνιών ανταλλαγής επιτοκίων σταθερά προς κυμαινόμενα

Αριθμός	Τύπος	Δείκτης Αναφοράς	Νόμισμα εκκαθάρισης	Ληκτότητα	Τύπος νομίσματος εκκαθάρισης	Δυνατότητα επιλογής	Τύπος ονομαστικής αξίας
A.2.1	Σταθερό προς κυμαινόμενο	Euribor	EUR	28H-50E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερή ή μεταβλητή

Πίνακας 3

Κατηγορίες προθεσμιακών συμφωνιών επιτοκίου

Αριθμός	Τύπος	Δείκτης Αναφοράς	Νόμισμα εκκαθάρισης	Ληκτότητα	Τύπος νομίσματος εκκαθάρισης	Δυνατότητα επιλογής	Τύπος ονομαστικής αξίας
A.3.1	FRA	Euribor	EUR	3H-3E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερή ή μεταβλητή

Πίνακας 4

Κατηγορίες συμφωνιών ανταλλαγής δείκτη για μία νύκτα

Αριθμός	Τύπος	Δείκτης Αναφοράς	Νόμισμα εκκαθάρισης	Ληκτότητα	Τύπος νομίσματος εκκαθάρισης	Δυνατότητα επιλογής	Τύπος ονομαστικής αξίας
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7H-3E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερή ή μεταβλητή
D.4.1	OIS	€STR	EUR	7H-3E	Ενιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερή ή μεταβλητή
D.4.2	OIS	SONIA	GBP	7H-50E	Ενιαίο	Όχι	Σταθερή ή

					νόμισμα		μεταβλητή
D.4.3	OIS	SOFR	USD	7H-3E	Ένιαίο νόμισμα	Όχι	Σταθερή ή μεταβλητή