



Euroopa Liidu
Nõukogu

Brüssel, 9. veebruar 2022
(OR. en)

6116/22
ADD 1

EF 44
ECOFIN 108
DELECT 21

SAATEMÄRKUSED

Saatja:	Euroopa Komisjoni peasekretär, allkirjastanud Martine DEPREZ, direktor
Kättesaamise kuupäev:	8. veebruar 2022
Saaja:	Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Euroopa Liidu Nõukogu peasekretär
Komisjoni dok nr:	C(2022) 619 final
Teema:	LISA järgmise dokumendi juurde: KOMISJONI DELEGEERITUD MÄÄRUS (EL) .../..., millega muudetakse delegeeritud määruses (EL) 2015/2205 sätestatud regulatiivseid tehnilisi standardeid seoses üleminekuga uutele võrdlusalustele, millele viidatakse teatavates börsivälistes tuletislepingutes

Käesolevaga edastatakse delegatsioonidele dokument C(2022) 619 final ANNEX.

Lisatud: C(2022) 619 final ANNEX



Brüssel, 8.2.2022
C(2022) 619 final

ANNEX

LISA

järgmise dokumendi juurde:

KOMISJONI DELEGEERITUD MÄÄRUS (EL) .../...,

millega muudetakse delegeeritud määruses (EL) 2015/2205 sätestatud regulatiivseid tehnilisi standardeid seoses üleminekuga uutele võrdlusalustele, millele viidatakse teatavates börsivälistes tuletislepingutes

LISA

„LISA

Börsiväliste intressimäära tuletisinstrumentide liigid, mille suhtes kohaldatakse kliiringukohustust

Tabel 1

Baasvahetustehingute liigid

Tunnus	Liik	Võrdlusindeks	Arveldusvaluuta	Tähtaeg	Arveldusvaluuta liik	Vaba valik	Tingliku väärtuse liik
A.1.1	baas	Euribor	EUR	28P–50A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv

Tabel 2

Intressimäärade vahetustehingute liigid, mille puhul fikseeritud intressimäär asendatakse ujuva intressimääraga (Fixed-to-Float)

Tunnus	Liik	Võrdlusindeks	Arveldusvaluuta	Tähtaeg	Arveldusvaluuta liik	Vaba valik	Tingliku väärtuse liik
A.2.1	Fixed-to-Float	Euribor	EUR	28P–50A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv

Tabel 3

Intressiforvardite liigid

Tunnus	Liik	Võrdlusindeks	Arveldusvaluuta	Tähtaeg	Arveldusvaluuta liik	Vaba valik	Tingliku väärtuse liik
A.3.1	FRA	Euribor	EUR	3P–3A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv

Tabel 4

Üleööintressi-vahetustehingute liigid

Tunnus	Liik	Võrdlusindeks	Arveldusvaluuta	Tähtaeg	Arveldusvaluuta liik	Vaba valik	Tingliku väärtuse liik
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7P–3A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv
D.4.1	OIS	€STR	EUR	7P–3A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv

D.4.2	OIS	SONIA	GBP	7P-50A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv
D.4.3	OIS	SOFR	USD	7P-3A	üks valuuta	ei	konstantne või muutuv