



Vijeće
Europske unije

Bruxelles, 9. veljače 2022.
(OR. en)

6116/22
ADD 1

EF 44
ECOFIN 108
DELECT 21

POP RATNA BILJEŠKA

Od: Glavna tajnica Europske komisije, potpisala direktorica Martine DEPREZ

Datum primitka: 8. veljače 2022.

Za: Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, glavni tajnik Vijeća Europske unije

Br. dok. Kom.: C(2022) 619 final

Predmet: PRILOG DELEGIRANOJ UREDBI KOMISIJE (EU) o izmjeni regulatornih tehničkih standarda utvrđenih u Delegiranoj uredbi (EU) 2015/2205 u pogledu prelaska na nove referentne vrijednosti na koje se poziva u određenim ugovorima o OTC izvedenicama

Za delegacije se u prilogu nalazi dokument C(2022) 619 final.

Priloženo: C(2022) 619 final



Bruxelles, 8.2.2022.
C(2022) 619 final

ANNEX

PRILOG

DELEGIRANOJ UREDBI KOMISIJE (EU)

o izmjeni regulatornih tehničkih standarda utvrđenih u Delegiranoj uredbi (EU) 2015/2205 u pogledu prelaska na nove referentne vrijednosti na koje se poziva u određenim ugovorima o OTC izvedenicama

PRILOG

„PRILOG

Vrste kamatnih OTC izvedenica koje podliježu obvezi poravnanja

Tablica 1.

Vrste ugovora o zamjeni osnove

Identifikacijska oznaka	Vrsta	Referentni indeks	Valuta namire	Preostalo dospijeće	Vrsta valute namire	Neobveznost	Vrsta zamišljenog iznosa
A.1.1	osnova	Euribor	EUR	28D-50Y	jedinstvena valuta	ne	stalan ili promjenjiv

Tablica 2.

Vrste kamatnih ugovora o razmjeni fiksne za promjenjivu kamatnu stopu

Identifikacijska oznaka	Vrsta	Referentni indeks	Valuta namire	Preostalo dospijeće	Vrsta valute namire	Neobveznost	Vrsta zamišljenog iznosa
A.2.1	fiksna za promjenjivu	Euribor	EUR	28D-50Y	jedinstvena valuta	ne	stalan ili promjenjiv

Tablica 3.

Vrste terminskih ugovora o kamatnoj stopi

Identifikacijska oznaka	Vrsta	Referentni indeks	Valuta namire	Preostalo dospijeće	Vrsta valute namire	Neobveznost	Vrsta zamišljenog iznosa
A.3.1	FRA	Euribor	EUR	3D-3Y	jedinstvena valuta	ne	stalan ili promjenjiv

Tablica 4.

Vrste prekonoćnih kamatnih ugovora o zamjeni

Identifikacijska oznaka	Vrsta	Referentni indeks	Valuta namire	Preostalo dospijeće	Vrsta valute namire	Neobveznost	Vrsta zamišljenog iznosa
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7D-3Y	jedinstvena valuta	ne	stalan ili promjenjiv

D.4.1	OIS	€STR	EUR	7D-3Y	jedinstvena valuta	ne	stalan ili promjenjiv
D.4.2	OIS	SONIA	GBP	7D-50Y	jedinstvena valuta	ne	stalan ili promjenjiv
D.4.3	OIS	SOFR	USD	7D-3Y	jedinstvena valuta	ne	stalan ili promjenjiv