



Az Európai Unió
Tanácsa

Brüsszel, 2022. február 9.
(OR. en)

6116/22
ADD 1

EF 44
ECOFIN 108
DELECT 21

FEDŐLAP

Küldi:	az Európai Bizottság főtitkára részéről Martine DEPREZ igazgató
Az átvétel dátuma:	2022. február 8.
Címzett:	Jeppé TRANHOLM-MIKKELSEN, az Európai Unió Tanácsának főtitkára
Biz. dok. sz.:	C(2022) 619 final
Tárgy:	MELLÉKLET a következőhöz: A BIZOTTSÁG (EU) .../... FELHATALMAZÁSON ALAPULÓ RENDELETE az (EU) 2015/2205 felhatalmazáson alapuló rendeletben meghatározott szabályozástechnikai standardok bizonyos, tőzsdén kívüli származtatott ügyletekben hivatkozott új referenciamutatókra való áttérés tekintetében történő módosításáról

Mellékelten továbbítjuk a delegációknak a C(2022) 619 final számú dokumentum
MELLÉKLETÉT.

Melléklet: C(2022) 619 final



Brüsszel, 2022.2.8.
C(2022) 619 final

ANNEX

MELLÉKLET

a következőhöz:

A BIZOTTSÁG (EU) .../... FELHATALMAZÁSON ALAPULÓ RENDELETE

az (EU) 2015/2205 felhatalmazáson alapuló rendeletben meghatározott szabályozástechnikai standardok bizonyos, tőzsdén kívüli származtatott ügyletekben hivatkozott új referenciamutatókra való áttérés tekintetében történő módosításáról

MELLÉKLET

„MELLÉKLET

Az elszámolási kötelezettség alá tartozó tőzsdén kívüli származtatott kamatügyletek kategóriái

1. táblázat

Báziskamat-csereügyletek kategóriái

Azonosító	Típus	Referenciaindex	Kiegyenlítés pénzneme	Lejárát	Kiegyenlítés pénznemének típusa	Opcionalitás	Névleges összeg típusa
A.1.1	Báziskamat	EURIBOR	EUR	28D- 50Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó

2. táblázat

Fix-változó kamatcsereügyletek kategóriái

Azonosító	Típus	Referenciaindex	Kiegyenlítés pénzneme	Lejárát	Kiegyenlítés pénznemének típusa	Opcionalitás	Névleges összeg típusa
A.2.1	Fix – változó	EURIBOR	EUR	28D- 50Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó

3. táblázat

Határidős kamatláb-megállapodások kategóriái

Azonosító	Típus	Referenciaindex	Kiegyenlítés pénzneme	Lejárát	Kiegyenlítés pénznemének típusa	Opcionalitás	Névleges összeg típusa
A.3.1	FRA	EURIBOR	EUR	3D-3Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó

4. táblázat

Egynapos kamatcsereügyletek kategóriái

Azonosító	Típus	Referenciaindex	Kiegyenlítés pénzneme	Lejárát	Kiegyenlítés pénznemének típusa	Opcionalitás	Névleges összeg típusa
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7D-3Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó
D.4.1	OIS	€STR	EUR	7D-3Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó

D.4.2	OIS	SONIA	GBP	7D-50Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó
D.4.3	OIS	SOFR	USD	7D-3Y	Egyetlen pénznem	Nem	Állandó vagy változó