



Europos Sąjungos
Taryba

Briuselis, 2022 m. vasario 9 d.
(OR. en)

6116/22
ADD 1

EF 44
ECOFIN 108
DELECT 21

PRIDEDAMAS PRANEŠIMAS

nuo: Europos Komisijos generalinės sekretorės, kurios vardu pasirašo
direktorė Martine DEPREZ

gavimo data: 2022 m. vasario 8 d.

kam: Europos Sąjungos Tarybos generaliniam sekretoriui Jeppe
TRANHOLMUI-MIKKELSENIUI

Komisijos dok. Nr.: C(2022) 619 final

Dalykas: KOMISIJOS DELEGUOTOJO REGLAMENTO (ES), kuriuo dėl perėjimo
prie naujų lyginamųjų indeksų, susietų su tam tikromis ne biržos
išvestinių finansinių priemonių sutartimis, iš dalies keičiami
Deleguotajame reglamente (ES) 2015/2205 nustatyti techniniai
reguliavimo standartai, PRIEDAS

Delegacijoms pridedamas dokumentas C(2022) 619 final ANNEX.

Priedama: C(2022) 619 final ANNEX



Briuselis, 2022 02 08
C(2022) 619 final

ANNEX

PRIEDAS

prie

KOMISIJOS DELEGUOTOJO REGLAMENTO (ES)

kuriuo dėl perėjimo prie naujų lyginamųjų indeksų, susietų su tam tikromis ne biržos išvestinių finansinių priemonių sutartimis, iš dalies keičiami Deleguotajame reglamente (ES) 2015/2205 nustatyti techniniai reguliavimo standartai

PRIEDAS

„PRIEDAS

Ne biržos palūkanų normų išvestinių finansinių priemonių, kurioms taikoma tarpuskaitos prievolė, klasės

1 lentelė

Bazės apskaitimo sandorių klasės

| Identifikavimo numeris | Rūšis | Bazinis indeksas | Atsiskaitymo valiuta | Terminas | Atsiskaitymo valiutos rūšis | Pasirinkimas | Tariamųjų sumos rūšis |
|------------------------|-------|------------------|----------------------|----------|-----------------------------|--------------|-----------------------|
| A.1.1 | Bazė | EURIBOR | EUR | 28D–50M | Viena valiuta | Ne | Pastovi arba kintama |

2 lentelė

Fiksuotos ir kintamos palūkanų normos apskaitimo sandorių klasės

| Identifikavimo numeris | Rūšis | Bazinis indeksas | Atsiskaitymo valiuta | Terminas | Atsiskaitymo valiutos rūšis | Pasirinkimas | Tariamųjų sumos rūšis |
|------------------------|---------------------|------------------|----------------------|----------|-----------------------------|--------------|-----------------------|
| A.2.1 | Fiksuota ir kintama | EURIBOR | EUR | 28D–50M | Viena valiuta | Ne | Pastovi arba kintama |

3 lentelė

Išankstinių palūkanų normų sandorių klasės

| Identifikavimo numeris | Rūšis | Bazinis indeksas | Atsiskaitymo valiuta | Terminas | Atsiskaitymo valiutos rūšis | Pasirinkimas | Tariamųjų sumos rūšis |
|------------------------|-------|------------------|----------------------|----------|-----------------------------|--------------|-----------------------|
| A.3.1 | FRA | EURIBOR | EUR | 3D–3M | Viena valiuta | Ne | Pastovi arba kintama |

4 lentelė

Vienos nakties indekso apskaitimo sandorių klasės

| Identifikavimo numeris | Rūšis | Bazinis indeksas | Atsiskaitymo valiuta | Terminas | Atsiskaitymo valiutos rūšis | Pasirinkimas | Tariamųjų sumos rūšis |
|------------------------|-------|------------------|----------------------|----------|-----------------------------|--------------|-----------------------|
| A.4.2 | OIS | FedFunds | USD | 7D–3M | Viena valiuta | Ne | Pastovi arba kintama |
| D.4.1 | OIS | €STR | EUR | 7D–3M | Viena valiuta | Ne | Pastovi arba kintama |
| D.4.2 | OIS | SONIA | GBP | 7D–50M | Viena valiuta | Ne | Pastovi arba kintama |
| D.4.3 | OIS | SOFR | USD | 7D–3M | Viena valiuta | Ne | Pastovi arba kintama |

