



Rada
Unii Europejskiej

Bruksela, 9 lutego 2022 r.
(OR. en)

6116/22
ADD 1

EF 44
ECOFIN 108
DELECT 21

PISMO PRZEWODNIE

Od: Sekretarz generalna Komisji Europejskiej (podpisała dyrektor Martine DEPREZ)

Data otrzymania: 8 lutego 2022 r.

Do: Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, sekretarz generalny Rady Unii Europejskiej

Nr dok. Kom.: C(2022) 619 final ANNEX

Dotyczy: ZAŁĄCZNIK do ROZPORZĄDZENIA DELEGOWANEGO KOMISJI (UE) .../... zmieniającego regulacyjne standardy techniczne określone w rozporządzeniu delegowanym (UE) 2015/2205 w odniesieniu do przejścia na nowe wskaźniki referencyjne stosowane jako odniesienie w niektórych kontraktach pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym

Delegacje otrzymują w załączeniu dokument C(2022) 619 final ANNEX.

Załącznik: C(2022) 619 final ANNEX

Bruksela, dnia 8.2.2022 r.
C(2022) 619 final

ANNEX

ZAŁĄCZNIK

do

ROZPORZĄDZENIA DELEGOWANEGO KOMISJI (UE) .../...

zmieniającego regulacyjne standardy techniczne określone w rozporządzeniu delegowanym (UE) 2015/2205 w odniesieniu do przejścia na nowe wskaźniki referencyjne stosowane jako odniesienie w niektórych kontraktach pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym

ZAŁĄCZNIK

„ZAŁĄCZNIK

Klasy instrumentów pochodnych na stopę procentową będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym podlegających obowiązkowi rozliczania

Tabela 1

Klasy swapów bazowych

Ref.	Rodzaj	Indeks referencyjny	Waluta rozliczeniowa	Okres zapadalności	Rodzaj waluty rozliczeniowej	Opcjonalność	Rodzaj kwoty referencyjnej
A.1.1	Bazowy	EURIBOR	EUR	28D-50Y	Jedna waluta	Nie	Stały lub zmienny

Tabela 2

Klasy swapów stóp procentowych stałych do zmiennych

Ref.	Rodzaj	Indeks referencyjny	Waluta rozliczeniowa	Okres zapadalności	Rodzaj waluty rozliczeniowej	Opcjonalność	Rodzaj kwoty referencyjnej
A.2.1	Stały do zmiennego	EURIBOR	EUR	28D-50Y	Jedna waluta	Nie	Stały lub zmienny

Tabela 3

Klasy kontraktów terminowych na stopę procentową

Ref.	Rodzaj	Indeks referencyjny	Waluta rozliczeniowa	Okres zapadalności	Rodzaj waluty rozliczeniowej	Opcjonalność	Rodzaj kwoty referencyjnej
A.3.1	FRA	EURIBOR	EUR	3D-3Y	Jedna waluta	Nie	Stały lub zmienny

Tabela 4

Klasy jednodniowych transakcji swap na rynku międzybankowym

Ref.	Rodzaj	Indeks referencyjny	Waluta rozliczeniowa	Okres zapadalności	Rodzaj waluty rozliczeniowej	Opcjonalność	Rodzaj kwoty referencyjnej
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7D-3Y	Jedna waluta	Nie	Stały lub zmienny
D.4.1	OIS	€STR	EUR	7D-3Y	Jedna waluta	Nie	Stały lub zmienny
D.4.2	OIS	SONIA	GPB	7D-50Y	Jedna waluta	Nie	Stały lub zmienny
D.4.3	OIS	SOFR	USD	7D-3Y	Jedna waluta	Nie	Stały lub zmienny

