



Rada
Európskej únie

V Bruseli 9. februára 2022
(OR. en)

6116/22
ADD 1

EF 44
ECOFIN 108
DELECT 21

SPRIEVODNÁ POZNÁMKA

Od:	Martine DEPREZOVÁ, riaditeľka, v zastúpení generálnej tajomníčky Európskej komisie
Dátum doručenia:	8. februára 2022
Komu:	Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, generálny tajomník Rady Európskej únie

Č. dok. Kom.:	C(2022) 619 final
Predmet:	PRÍLOHA k DELEGOVANÉMU NARIADENIU KOMISIE (EÚ), ktorým sa menia regulačné technické predpisy stanovené v delegovanom nariadení (EÚ) 2015/2205, pokiaľ ide o prechod na nové referenčné hodnoty, na ktoré sa odkazuje v určitých zmluvách o OTC derivátoch

Delegáciám v prílohe zasielame dokument C(2022) 619 final.

Príloha: C(2022) 619 final



V Bruseli 8. 2. 2022
C(2022) 619 final

ANNEX

PRÍLOHA

k

DELEGOVANÉMU NARIADENIU KOMISIE (EÚ),

ktorým sa menia regulačné technické predpisy stanovené v delegovanom nariadení (EÚ) 2015/2205, pokiaľ ide o prechod na nové referenčné hodnoty, na ktoré sa odkazuje v určitých zmluvách o OTC derivátoch

PRÍLOHA

„PRÍLOHA

Triedy úrokových OTC derivátov, ktoré podliehajú zúčtovacej povinnosti

Tabuľka 1

Triedy základných swapov

Id	Druh	Referenčný index	Vyrovnávací mena	Splatnosť	Druh vyrovnávacej meny	Voliteľnosť	Druh nominálnej hodnoty
A.1.1	bázičkový	EURIBOR	EUR	28 dní – 50 rokov	jedna mena	nie	konštantná alebo variabilná

Tabuľka 2

Triedy swapov pevnej/pohyblivej úrokovej sadzby

Id	Druh	Referenčný index	Vyrovnávací mena	Splatnosť	Druh vyrovnávacej meny	Voliteľnosť	Druh nominálnej hodnoty
A.2.1	swap pevnej/pohyblivej úrokovej sadzby	EURIBOR	EUR	28 dní – 50 rokov	jedna mena	nie	konštantná alebo variabilná

Tabuľka 3

Triedy dohôd o forwardovej úrokovej miere

Id	Druh	Referenčný index	Vyrovnávací mena	Splatnosť	Druh vyrovnávacej meny	Voliteľnosť	Druh nominálnej hodnoty
A.3.1	FRA	EURIBOR	EUR	3 dni – 3 roky	jedna mena	nie	konštantná alebo variabilná

Tabuľka 4

Triedy jednoduchých indexových swapov („overnight index swap“)

Id	Druh	Referenčný index	Vyrovnávací mena	Splatnosť	Druh vyrovnávacej meny	Voliteľnosť	Druh nominálnej hodnoty
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7 dní – 3 roky	jedna mena	nie	konštantná alebo variabilná
D.4.1	OIS	EURSTR	EUR	7 dní – 3 roky	jedna mena	nie	konštantná alebo variabilná
D.4.2	OIS	SONIA	GBP	7 dní – 50	jedna mena	nie	konštantná alebo

				rokov			variabilná
D.4.3	OIS	SOFR	USD	7 dní – 3 roky	jedna mena	nie	konštantná alebo variabilná