

Bruselj, 9. februar 2022
(OR. en)

6116/22
ADD 1

EF 44
ECOFIN 108
DELECT 21

SPREMNI DOPIS

Pošiljatelj: za generalno sekretarko Evropske komisije:
direktorica Martine DEPREZ

Datum prejema: 8. februar 2022

Prejemnik: generalni sekretar Sveta Evropske unije Jeppe TRANHOLM-
MIKKELSEN

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

Zadeva: PRILOGA k DELEGIRANI UREDBI KOMISIJE (EU) o spremembi
regulativnih tehničnih standardov iz Delegirane uredbe (EU) 2015/2205
glede prehoda na nove referenčne vrednosti, na katere se sklicujejo
določene pogodbe o izvedenih finančnih instrumentih OTC

Delegacije prejmejo priloženi dokument C(2022) 619 final ANNEX.

Priloga: C(2022) 619 final ANNEX



Bruselj, 8.2.2022
C(2022) 619 final

ANNEX

PRILOGA

k

DELEGIRANI UREDBI KOMISIJE (EU)

**o spremembi regulativnih tehničnih standardov iz Delegirane uredbe (EU) 2015/2205
glede prehoda na nove referenčne vrednosti, na katere se sklicujejo določene pogodbe o
izvedenih finančnih instrumentih OTC**

PRILOGA

„PRILOGA

Razredi obrestnih izvedenih finančnih instrumentov OTC, za katere velja obveznost kliringa

Tabela 1

Razredi zamenjav osnove (*Basis swaps*)

Id. št.	Vrsta	Referenčni indeks	Valuta poravnave	Zapadlost	Vrsta valute poravnave	Izbirnost (<i>optionality</i>)	Vrsta osnove
A.1.1	zamenjava osnove	EURIBOR	EUR	28D-50L	ena valuta	ne	konstantna ali variabilna

Tabela 2

Razredi zamenjav fiksne za variabilno obrestno mero (*Fixed-to-Float interest rate swaps*)

Id. št.	Vrsta	Referenčni indeks	Valuta poravnave	Zapadlost	Vrsta valute poravnave	Izbirnost (<i>optionality</i>)	Vrsta osnove
A.2.1	fiksna za variabilno	EURIBOR	EUR	28D-50L	ena valuta	ne	konstantna ali variabilna

Tabela 3

Razredi dogovorov o terminski obrestni meri (*Forward rate agreements – FRA*)

Id. št.	Vrsta	Referenčni indeks	Valuta poravnave	Zapadlost	Vrsta valute poravnave	Izbirnost (<i>optionality</i>)	Vrsta osnove
A.3.1	FRA	EURIBOR	EUR	3D-3L	ena valuta	ne	konstantna ali variabilna

Tabela 4

Razredi zamenjav obrestne mere čez noč za fiksno (*Overnight index swaps – OIS*)

Id. št.	Vrsta	Referenčni indeks	Valuta poravnave	Zapadlost	Vrsta valute poravnave	Izbirnost (<i>optionality</i>)	Vrsta osnove
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7D-3L	ena valuta	ne	konstantna ali variabilna
D.4.1	OIS	€STR	EUR	7D-3L	ena valuta	ne	konstantna ali variabilna
D.4.2	OIS	SONIA	GBP	7D-50L	ena valuta	ne	konstantna ali

							variabilna
D.4.3	OIS	SOFR	USD	7D-3L	ena valuta	ne	konstantna ali variabilna