

1.13.1 Vaihtuvien korkojen määritelmät

a) Euro

- i) EUR-EURIBOR-Reuters tarkoittaa, että korkojakson korko on euromääräisten, sovitun korkojakson pituisten talletusten korko Reutersin sivulla EURIBOR01 klo 11:00 Brysselin aikaa kaksi TARGET-pankkipäivää ennen korkojakson alkamispäivää.
- ii) EUR-LIBOR-BBA tarkoittaa, että korkojakson korko on euromääräisten, sovitun korkojakson pituisten talletusten korko Reutersin sivulla LIBOR01 klo 11:00 Lontoon aikaa kaksi TARGET-pankkipäivää ennen korkojakson alkamispäivää.
- iii) EUR-EONIA tarkoittaa, että korkojakson korko on euromääräisten yliyön talletusten kyseiselle TARGET-pankkipäivälle määritelty korko Reutersin sivulla EONIA ("**EONIA-korko**").
- iv) EUR-EONIA-OIS-COMPOUND tarkoittaa, että korko on päivittäinen korkoa korolle tuotto, joka lasketaan alla olevan kaavan mukaisesti. Kaavassa viitekorkona käytetään Euro Overnight Index Average (EONIA).

$$\left[\prod_{i=1}^{d_0} \left[1 + \frac{EONIA_i \times n_i}{360} \right] - 1 \right] \frac{360}{d}$$

jossa

d_0 = koronlaskentakauteen sisältyvien TARGET-pankkipäivien lukumäärä

i = numerosarja yhdestä d_0 :aan edustaen jokaista TARGET-pankkipäivää kronologisessa järjestyksessä alkaen koronlaskentakauden ensimmäisestä TARGET-pankkipäivästä

$EONIA_i$ = koronlaskentakauteen sisältyvään jokaiseen päivään i sovellettava EONIA-korko

n_i = niiden kalenteripäivien lukumäärä, jolta edellä mainittua EONIA-korkoa lasketaan

d = koronlaskentakauteen sisältyvien kalenteripäivien lukumäärä.

- v) EuroSTR tarkoittaa €STR-korkoa (euro short term rate), jota hallinnoi Euroopan keskuspankki (EKP) (tai sen seuraaja) EKP:n verkkosivustolta.

b) Australian dollari

- i) AUD-LIBOR-BBA tarkoittaa, että korkojakson korko on Australian dollarin määräisten, sovitun korkojakson pituisten talletusten korko Reutersin sivulla LIBOR02 klo 11:00 Lontoon aikaa kaksi Lontoon pankkipäivää ennen korkojakson alkamispäivää.
- ii) AUD-BBR-AUBBSW tarkoittaa, että korkojakson korko on pääpankkien hyväksyttävien arvopapereiden korko viimeisenä korkona Reutersin sivulla 0#AUBBSW= noin klo 10:10 Sydneyn aikaa korkojakson alkamispäivänä.
- iii) AUD-BBR-BBSW tarkoittaa, että korkojakson korko on pääpankkien sovitun korkojakson pituisten hyväksyttävien arvopapereiden korko AVG MID:nä Reutersin sivulla BBSW noin klo 10:10 Sydneyn aikaa korkojakson alkamispäivänä.

c) Englannin punta

GBP-LIBOR-BBA tarkoittaa, että korkojakson korko on Englannin punnan määräisten, sovitun korkojakson pituisten talletusten korko Reutersin sivulla LIBOR01 klo 11:00 Lontoon aikaa korkojakson alkamispäivänä.

d) Hongkongin dollari

HKD-HIBOR-HKAB tarkoittaa, että korkojakson korko on Hongkongin dollarin määräisten, sovitun korkojakson pituisten talletusten korko Reutersin sivulla HKABHIBOR klo 11:00 Hongkongin aikaa korkojakson alkamispäivänä.

e) Japanin jeni

JPY-LIBOR-BBA tarkoittaa, että korkojakson korko on Japanin jenin määräisten, sovitun korkojakson pituisten talletusten korko Reutersin sivulla 3750 klo 11:00 Lontoon aikaa kaksi Lontoon pankkipäivää ennen korkojakson alkamispäivää.

f) Kanadan dollari

i) CAD-LIBOR-BBA tarkoittaa, että korkojakson korko on Kanadan dollarin määräisten, sovitun korkojakson pituisten talletusten korko Reutersin sivulla LIBOR01 klo 11:00 Lontoon aikaa kaksi Lontoon pankkipäivää ennen korkojakson alkamispäivää.

ii) CAD-BA-CDOR tarkoittaa, että korkojakson korko on keskiporko Kanadan dollarin määräisten pankkiirien hyväksymänä sovitun pituiselle korkojaksolle Reutersin sivulla CDOR klo 10:00 Toronton aikaa korkojakson alkamispäivänä.

g) Norjan kruunu

NOK-NIBOR-OIBOR tarkoittaa, että korkojakson korko on Norjan kruunun määräisten, sovitun korkojakson pituisten talletusten korko Reutersin sivulla OIBOR= klo 12:00 Oslon aikaa kaksi Oslon pankkipäivää ennen korkojakson alkamispäivää.

h) Puolan zloty

PLN-WIBOR-WIBO tarkoittaa, että korkojakson korko on Puolan zlotyn määräisten, sovitun korkojakson pituisten talletusten korko Reutersin sivulla WIBOR= klo 11:00 Varsovan aikaa kaksi Varsovan pankkipäivää ennen korkojakson alkamispäivää.

i) Ruotsin kruunu

SEK-STIBOR-SIDE tarkoittaa, että korkojakson korko on Ruotsin kruunun määräisten, sovitun korkojakson pituisten talletusten korko Reutersin sivulla SIDE otsikon FIXINGS alla klo 11:00 Tukholman aikaa kaksi Tukholman pankkipäivää ennen korkojakson alkamispäivää.

j) Sveitsin frangi

CHF-LIBOR-BBA tarkoittaa, että korkojakson korko on Sveitsin frangin määräisten, sovitun korkojakson pituisten talletusten korko Reutersin sivulla LIBOR02 klo 11:00 Lontoon aikaa kaksi Lontoon pankkipäivää ennen korkojakson alkamispäivää.

k) Tanskan kruunu

DKK-CIBOR-DKNA13 tarkoittaa, että korkojakson korko on Tanskan kruunun määräisten, sovitun korkojakson pituisten talletusten korko Reutersin sivulla DKNA13 klo 11:00 Kööpenhaminan aikaa korkojakson alkamispäivänä.

l) Venäjän rupla

RUB-MOSPRIME-NFEA tarkoittaa, että korkojakson korko on ruplamääräisten, sovitun korkojakson pituisten talletusten korko Reutersin sivulla MOSPRIME1 klo 12:30 Moskovan aikaa yksi Moskovan pankkipäivä ennen korkojakson alkamispäivää.

m) Yhdysvaltain dollari

USD-LIBOR-BBA tarkoittaa, että korkojakson korko on Yhdysvaltain dollarin määräisten, sovitun korkojakson pituisten talletusten korko Reutersin sivulla LIBOR01 klo 11:00 Lontoon aikaa kaksi Lontoon pankkipäivää ennen korkojakson alkamispäivää.