



Rådet for
Den Europæiske Union

Bruxelles, den 9. februar 2022
(OR. en)

6116/22
ADD 1

EF 44
ECOFIN 108
DELECT 21

FØLGESKRIVELSE

fra: Martine DEPREZ, direktør, på vegne af generalsekretæren for Europa-Kommissionen

modtaget: 8. februar 2022

til: Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, generalsekretær for Rådet for Den Europæiske Union

Komm. dok. nr.: C(2022) 619 final

Vedr.: BILAG til KOMMISSIONENS DELEGEREDE FORORDNING (EU) om ændring af de reguleringsmæssige tekniske standarder fastsat i delegeret forordning (EU) 2015/2205 for så vidt angår overgangen til nye benchmarks, der anvendes som reference i visse OTC-derivataftaler

Hermed følger til delegationerne dokument C(2022) 619 final ANNEX.

Bilag: C(2022) 619 final ANNEX



EUROPA-
KOMMISSIONEN

Bruxelles, den 8.2.2022
C(2022) 619 final

ANNEX

BILAG

til

KOMMISSIONENS DELEGEREDE FORORDNING (EU)

om ændring af de reguleringsmæssige tekniske standarder fastsat i delegeret forordning (EU) 2015/2205 for så vidt angår overgangen til nye benchmarks, der anvendes som reference i visse OTC-derivataftaler

BILAG

"BILAG

OTC-rentederivatklasser omfattet af clearingforpligtelsen

Tabel 1

Basisswapklasser

Id	Type	Referenceindeks	Afviklingsvaluta	Løbetid	Afviklingsvalutatype	Optionalitet	Notional værditype
A.1.1	Basiss	Euribor	EUR	28D-50Å	Fælles valuta	Nej	Konstant eller variabel

Tabel 2

Fixed-to-floating renteswapklasser

Id	Type	Referenceindeks	Afviklingsvaluta	Løbetid	Afviklingsvalutatype	Optionalitet	Notional værditype
A.2.1	Fixed-to-floating	Euribor	EUR	28D-50Å	Fælles valuta	Nej	Konstant eller variabel

Tabel 3

Klasser af forward rate agreements

Id	Type	Referenceindeks	Afviklingsvaluta	Løbetid	Afviklingsvalutatype	Optionalitet	Notional værditype
A.3.1	FRA	Euribor	EUR	3D-3Å	Fælles valuta	Nej	Konstant eller variabel

Tabel 4

Klasser af dag-til-dag indeksswaps

Id	Type	Referenceindeks	Afviklingsvaluta	Løbetid	Afviklingsvalutatype	Optionalitet	Notional værditype
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7D-3Å	Fælles valuta	Nej	Konstant eller variabel
D.4.1	OIS	EURSTR	EUR	7D-3Å	Fælles valuta	Nej	Konstant eller variabel

D.4. 2	OIS	SONIA	GBP	7D- 50Å	Fælles valuta	Nej	Konstan t eller variabel
D.4. 3	OIS	SOFR	USD	7D-3Å	Fælles valuta	Nej	Konstan t eller variabel