



Rat der
Europäischen Union

Brüssel, den 9. Februar 2022
(OR. en)

6116/22
ADD 1

EF 44
ECOFIN 108
DELECT 21

ÜBERMITTLUNGSVERMERK

Absender:	Frau Martine DEPREZ, Direktorin, im Auftrag der Generalsekretärin der Europäischen Kommission
Eingangsdatum:	8. Februar 2022
Empfänger:	Herr Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Generalsekretär des Rates der Europäischen Union

Nr. Komm.dok.:	C(2022) 619 final - ANNEX
Betr.:	ANHANG der DELEGIERTEN VERORDNUNG (EU) DER KOMMISSION zur Änderung der in der Delegierten Verordnung (EU) 2015/2205 festgelegten technischen Regulierungsstandards mit dem Ziel, der Umstellung auf neue Referenzzinssätze bei bestimmten OTC-Derivatkontrakten Rechnung zu tragen

Die Delegationen erhalten in der Anlage das Dokument C(2022) 619 final - ANNEX.

Anl.: C(2022) 619 final - ANNEX



EUROPÄISCHE
KOMMISSION

Brüssel, den 8.2.2022
C(2022) 619 final

ANNEX

ANHANG

der

DELEGIERTEN VERORDNUNG (EU) DER KOMMISSION

**zur Änderung der in der Delegierten Verordnung (EU) 2015/2205 festgelegten
technischen Regulierungsstandards mit dem Ziel, der Umstellung auf neue
Referenzzinssätze bei bestimmten OTC-Derivatkontrakten Rechnung zu tragen**

ANHANG

„ANHANG

Clearingpflichtige Kategorien von OTC-Zinsderivaten

Tabelle 1

Kategorien von Basisswaps

ID	Art	Referenzzinssatz	Abwicklungswährung	Laufzeit	Art der Abwicklungswährung	Option	Art des Nominalwerts
A.1.1	Basis	Euribor	EUR	28D-50Y	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel

Tabelle 2

Kategorien von Fixed-to-Float-Zinsswaps

ID	Art	Referenzzinssatz	Abwicklungswährung	Laufzeit	Art der Abwicklungswährung	Option	Art des Nominalwerts
A.2.1	Fixed-to-Float	Euribor	EUR	28D-50Y	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel

Tabelle 3

Kategorien von Forward Rate Agreements

ID	Art	Referenzzinssatz	Abwicklungswährung	Laufzeit	Art der Abwicklungswährung	Option	Art des Nominalwerts
A.3.1	FRA	Euribor	EUR	3D-3Y	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel

Tabelle 4

Kategorie von Overnight-Index-Swaps

ID	Art	Referenzzinssatz	Abwicklungswährung	Laufzeit	Art der Abwicklungswährung	Option	Art des Nominalwerts
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7D-3Y	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel
D.4.1	OIS	€STR	EUR	7D-3Y	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel
D.4.2	OIS	SONIA	GBP	7D-50Y	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel
D.4.3	OIS	SOFR	USD	7D-3Y	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel