



Consejo de la  
Unión Europea

Bruselas, 9 de febrero de 2022  
(OR. en)

6116/22  
ADD 1

EF 44  
ECOFIN 108  
DELECT 21

#### NOTA DE TRANSMISIÓN

---

De: Por la secretaria general de la Comisión Europea, D.<sup>a</sup> Martine DEPREZ, directora

Fecha de recepción: 8 de febrero de 2022

A: D. Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, secretario general del Consejo de la Unión Europea

---

N.º doc. Ción.: C(2022) 619 final - ANNEX

---

Asunto: ANEXO del REGLAMENTO DELEGADO (UE) .../... DE LA COMISIÓN por el que se modifican las normas técnicas de regulación establecidas en el Reglamento Delegado (UE) 2015/2205 en lo que respecta a la transición hacia los nuevos índices de referencia utilizados en determinados contratos de derivados extrabursátiles

---

Adjunto se remite a las Delegaciones el documento – C(2022) 619 final - ANNEX.

---

Adj.: C(2022) 619 final - ANNEX



Bruselas, 8.2.2022  
C(2022) 619 final

ANNEX

**ANEXO**

**del**

**REGLAMENTO DELEGADO (UE) .../... DE LA COMISIÓN**

**por el que se modifican las normas técnicas de regulación establecidas en el Reglamento Delegado (UE) 2015/2205 en lo que respecta a la transición hacia los nuevos índices de referencia utilizados en determinados contratos de derivados extrabursátiles**

## ANEXO

### «ANEXO

Categorías de derivados extrabursátiles de tipos de interés sujetas a la obligación de compensación

*Cuadro 1*

#### **Categorías de permutas de bases**

<b>Identificador</b>	<b>Tipo</b>	<b>Índice de referencia</b>	<b>Moneda de liquidación</b>	<b>Vencimiento</b>	<b>Tipo de moneda de liquidación</b>	<b>Opcionalidad</b>	<b>Tipo nocional</b>
A.1.1	De bases	EURIBOR	EUR	28D-50A	Moneda única	No	Constante o variable

*Cuadro 2*

#### **Categorías de permutas financieras de tipos de interés fijo contra variable**

<b>Identificado r</b>	<b>Tipo</b>	<b>Índice de referencia</b>	<b>Moneda de liquidación</b>	<b>Vencimiento</b>	<b>Tipo de moneda de liquidación</b>	<b>Opcionalidad</b>	<b>Tipo nocional</b>
A.2.1	Fijo contra variable	EURIBOR	EUR	28D-50A	Moneda única	No	Constante o variable

*Cuadro 3*

#### **Categorías de acuerdos sobre tipos de interés futuros (FRA)**

<b>Identificador</b>	<b>Tipo</b>	<b>Índice de referencia</b>	<b>Moneda de liquidación</b>	<b>Vencimiento</b>	<b>Tipo de moneda de liquidación</b>	<b>Opcionalidad</b>	<b>Tipo nocional</b>
A.3.1	FRA	EURIBOR	EUR	3D-3A	Moneda única	No	Constante o variable

*Cuadro 4*

#### **Categorías de permutas financieras sobre índices a un día (OIS)**

<b>Identificador</b>	<b>Tipo</b>	<b>Índice de referencia</b>	<b>Moneda de liquidación</b>	<b>Vencimiento</b>	<b>Tipo de moneda de liquidación</b>	<b>Opcionalidad</b>	<b>Tipo nocional</b>
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7D-3A	Moneda única	No	Constante o variable
D.4.1	OIS	€STR	EUR	7D-3A	Moneda única	No	Constante o variable
D.4.2	OIS	SONIA	GBP	7D-50A	Moneda única	No	Constante o variable

D.4.3	OIS	SOFR	USD	7D-3A	Moneda única	No	Constante o variable
-------	-----	------	-----	-------	-----------------	----	-------------------------