

Bruxelles, le 9 février 2022
(OR. en)

6116/22
ADD 1

EF 44
ECOFIN 108
DELECT 21

NOTE DE TRANSMISSION

Origine:	Pour la secrétaire générale de la Commission européenne, Madame Martine DEPREZ, directrice
Date de réception:	8 février 2022
Destinataire:	Monsieur Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, secrétaire général du Conseil de l'Union européenne
N° doc. Cion:	C(2022) 619 final - ANNEXE
Objet:	ANNEXE du RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ DE LA COMMISSION (UE) modifiant les normes techniques de réglementation définies par le règlement délégué (UE) 2015/2205 en ce qui concerne la transition vers de nouveaux indices de référence auxquels se réfèrent certains contrats dérivés de gré à gré

Les délégations trouveront ci-joint le document C(2022) 619 final - ANNEXE.

p.j.: C(2022) 619 final - ANNEXE



Bruxelles, le 8.2.2022
C(2022) 619 final

ANNEX

ANNEXE

du

RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ DE LA COMMISSION (UE)

modifiant les normes techniques de réglementation définies par le règlement délégué (UE) 2015/2205 en ce qui concerne la transition vers de nouveaux indices de référence auxquels se réfèrent certains contrats dérivés de gré à gré

ANNEXE

«ANNEXE

Catégories de dérivés de taux d'intérêt de gré à gré soumises à l'obligation de compensation centrale

Tableau 1

Catégories de swaps de base

Identifiant	Type	Indice de référence	Devise de règlement	Durée résiduelle	Type de devise de règlement	Optionalité	Type de notionnel
A.1.1	de base	EURIBOR	EUR	28 J-50A	Devise unique	Non	Constant ou variable

Tableau 2

Catégories de swaps de taux d'intérêt fixe contre variable

Identifiant	Type	Indice de référence	Devise de règlement	Durée résiduelle	Type de devise de règlement	Optionalité	Type de notionnel
A.2.1.	Fixe contre variable	EURIBOR	EUR	28 J-50A	Devise unique	Non	Constant ou variable

Tableau 3

Catégories de contrats à terme de taux

Identifiant	Type	Indice de référence	Devise de règlement	Durée résiduelle	Type de devise de règlement	Optionalité	Type de notionnel
A.3.1.	FRA	EURIBOR	EUR	3 J-3A	Devise unique	Non	Constant ou variable

Tableau 4

Catégories de swaps indexés sur le taux à un jour

Identifiant	Type	Indice de référence	Devise de règlement	Durée résiduelle	Type de devise de règlement	Optionalité	Type de notionnel
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7 J-3A	Devise unique	Non	Constant ou variable
D.4.1	OIS	EURSTR	EUR	7 J-3A	Devise unique	Non	Constant ou variable

D.4.2	OIS	SONIA	GBP	7 J-50A	Devise unique	Non	Constant ou variable
D.4.3	OIS	SOFR	USD	7 J-3A	Devise unique	Non	Constant ou variable

»