



Bruxelles, 9 febbraio 2022
(OR. en)

6116/22
ADD 1

EF 44
ECOFIN 108
DELECT 21

NOTA DI TRASMISSIONE

Origine:	Segretaria generale della Commissione europea, firmato da Martine DEPREZ, direttrice
Data:	8 febbraio 2022
Destinatario:	Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, segretario generale del Consiglio dell'Unione europea
n. doc. Comm.:	C(2022) 619 final ANNEX
Oggetto:	ALLEGATO del REGOLAMENTO DELEGATO (UE).../...DELLA COMMISSIONE recante modifica delle norme tecniche di regolamentazione stabilite dal regolamento delegato (UE) 2015/2205 per quanto riguarda la transizione ai nuovi indici di riferimento cui sono collegati taluni contratti derivati OTC

Si trasmette in allegato, per le delegazioni, il documento C(2022) 619 final ANNEX.

All.: C(2022) 619 final ANNEX



COMMISSIONE
EUROPEA

Bruxelles, 8.2.2022
C(2022) 619 final

ANNEX

ALLEGATO

del

REGOLAMENTO DELEGATO (UE).../...DELLA COMMISSIONE

recante modifica delle norme tecniche di regolamentazione stabilite dal regolamento delegato (UE) 2015/2205 per quanto riguarda la transizione ai nuovi indici di riferimento cui sono collegati taluni contratti derivati OTC

ALLEGATO

"ALLEGATO

Categorie di derivati OTC su tassi d'interesse soggette all'obbligo di compensazione

Tabella 1

Categorie di swap di base

id	Tipo	Indice di riferimento	Valuta di regolamento	Scadenza	Tipo di valuta di regolamento	Facoltatività	Tipo nozionale
A.1.1	Base	EURIBOR	EUR	28D-50Y	Valuta unica	No	Costante o variabile

Tabella 2

Categorie di Fixed-To-Float interest rate swap

id	Tipo	Indice di riferimento	Valuta di regolamento	Scadenza	Tipo di valuta di regolamento	Facoltatività	Tipo nozionale
A.2.1	Fixed- to-Float	EURIBOR	EUR	28D-50Y	Valuta unica	No	Costante o variabile

Tabella 3

Categorie di forward rate agreement

id	Tipo	Indice di riferimento	Valuta di regolamento	Scadenza	Tipo di valuta di regolamento	Facoltatività	Tipo nozionale
A.3.1	FRA	EURIBOR	EUR	3D-3Y	Valuta unica	No	Costante o variabile

Tabella 4

Categorie di overnight index swap

id	Tipo	Indice di riferimento	Valuta di regolamento	Scadenza	Tipo di valuta di regolamento	Facoltatività	Tipo nozionale
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7D-3Y	Valuta unica	No	Costante o variabile
D.4.1	OIS	€STR	EUR	7D-3Y	Valuta unica	No	Costante o variabile
D.4.2	OIS	SONIA	GBP	7D-50Y	Valuta unica	No	Costante o variabile
D.4.3	OIS	SOFR	USD	7D-3Y	Valuta unica	No	Costante o variabile