



Raad van de  
Europese Unie

Brussel, 9 februari 2022  
(OR. en)

6116/22  
ADD 1

EF 44  
ECOFIN 108  
DELECT 21

### BEGELEIDENDE NOTA

---

van:	de secretaris-generaal van de Europese Commissie, ondertekend door mevrouw Martine DEPREZ, directeur
ingekomen:	8 februari 2022
aan:	de heer Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, secretaris-generaal van de Raad van de Europese Unie
nr. Comdoc.:	C(2022) 619 final ANNEX
Betreft:	BIJLAGE bij GEDELEGEERDE VERORDENING (EU) .../... VAN DE COMMISSIE tot wijziging van de technische reguleringsnormen van de Gedelegeerde Verordening (EU) 2015/2205 wat betreft de overgang naar nieuwe benchmarks in bepaalde otc-derivatencontracten

---

Hierbij gaat voor de delegaties document C(2022) 619 final ANNEX.

---

Bijlage: C(2022) 619 final ANNEX



Brussel, 8.2.2022  
C(2022) 619 final

ANNEX

**BIJLAGE**

**bij**

**GEDELEGEERDE VERORDENING (EU) .../... VAN DE COMMISSIE**

**tot wijziging van de technische reguleringsnormen van de Gedelegeerde Verordening (EU) 2015/2205 wat betreft de overgang naar nieuwe benchmarks in bepaalde otc-derivatencontracten**

## **BIJLAGE**

### **“BIJLAGE**

Aan de clearingverplichting onderworpen klassen van otc-rentederivaten

*Tabel 1*

#### **Klassen van basisswaps**

<b>Id</b>	<b>Type</b>	<b>Referentie-index</b>	<b>Afwikkelingsvaluta</b>	<b>Looptijd</b>	<b>Afwikkelingsvalutatype</b>	<b>Optionaliteit</b>	<b>Type nominale waarde</b>
A.1.1	Basis	Euribor	EUR	28D-50J	Op basis van één valuta	Neen	Constant of variabel

*Tabel 2*

#### **Klassen van swaps van vaste voor variabele rente**

<b>Id</b>	<b>Type</b>	<b>Referentie-index</b>	<b>Afwikkelingsvaluta</b>	<b>Looptijd</b>	<b>Afwikkelingsvalutatype</b>	<b>Optionaliteit</b>	<b>Type nominale waarde</b>
A.2.1	Vaste voor variabele rente	Euribor	EUR	28D-50J	Op basis van één valuta	Neen	Constant of variabel

*Tabel 3*

#### **Klassen van rentetermijncontracten (forward rate agreements)**

<b>Id</b>	<b>Type</b>	<b>Referentie-index</b>	<b>Afwikkelingsvaluta</b>	<b>Looptijd</b>	<b>Afwikkelingsvalutatype</b>	<b>Optionaliteit</b>	<b>Type nominale waarde</b>
A.3.1	FRA	Euribor	EUR	3D-3J	Op basis van één valuta	Neen	Constant of variabel

*Tabel 4*

#### **Klassen van overnight index swaps**

<b>Id</b>	<b>Type</b>	<b>Referentie-index</b>	<b>Afwikkelingsvaluta</b>	<b>Looptijd</b>	<b>Afwikkelingsvalutatype</b>	<b>Optionaliteit</b>	<b>Type nominale waarde</b>
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7D-3J	Op basis van één valuta	Neen	Constant of variabel

D.4.1	OIS	€STR	EUR	7D-3J	Op basis van één valuta	Neen	Constant of variabel
D.4.2	OIS	SONIA	GBP	7D-50J	Op basis van één valuta	Neen	Constant of variabel
D.4.3	OIS	SOFR	USD	7D-3J	Op basis van één valuta	Neen	Constant of variabel