



Conselho da
União Europeia

Bruxelas, 9 de fevereiro de 2022
(OR. en)

6116/22
ADD 1

EF 44
ECOFIN 108
DELECT 21

NOTA DE ENVIO

de:	Secretária-geral da Comissão Europeia, com a assinatura de Martine DEPREZ, diretora
data de receção:	8 de fevereiro de 2022
para:	Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Secretário-Geral do Conselho da União Europeia

n.º doc. Com.:	C(2022) 619 final - ANEXO
Assunto:	ANEXO do REGULAMENTO DELEGADO (UE) DA COMISSÃO que altera as normas técnicas de regulamentação estabelecidas no Regulamento Delegado (UE) 2015/2205 no que respeita à transição para novos índices de referência referenciados em determinados contratos de derivados OTC

Envia-se em anexo, à atenção das delegações, o documento C(2022) 619 final - ANEXO.

Anexo: C(2022) 619 final - ANEXO



Bruxelas, 8.2.2022
C(2022) 619 final

ANNEX

ANEXO

do

REGULAMENTO DELEGADO (UE) DA COMISSÃO

que altera as normas técnicas de regulamentação estabelecidas no Regulamento Delegado (UE) 2015/2205 no que respeita à transição para novos índices de referência referenciados em determinados contratos de derivados OTC

ANEXO

«ANEXO

Classes de derivados de taxa de juro OTC sujeitas à obrigação de compensação

Quadro 1

Classes de swaps de base

ID	Tipo	Índice de referencial	Moeda de liquidação	Prazo de vencimento	Tipo de moeda de liquidação	Opcionalidade	Tipo nocional
A.1.1	Base	Euribor	EUR	28D-50A	Moeda única	Não	Constante ou variável

Quadro 2

Classes de swaps de taxa de juro fixa contra variável

ID	Tipo	Índice de referencial	Moeda de liquidação	Prazo de vencimento	Tipo de moeda de liquidação	Opcionalidade	Tipo nocional
A.2.1	Fixa contra variável	Euribor	EUR	28D-50A	Moeda única	Não	Constante ou variável

Quadro 3

Classes de contratos a prazo de taxa de juro

ID	Tipo	Índice de referencial	Moeda de liquidação	Prazo de vencimento	Tipo de moeda de liquidação	Opcionalidade	Tipo nocional
A.3.1	FRA	Euribor	EUR	3D-3A	Moeda única	Não	Constante ou variável

Quadro 4

Classes de swaps associados a um índice overnight

ID	Tipo	Índice de referencial	Moeda de liquidação	Prazo de vencimento	Tipo de moeda de liquidação	Opcionalidade	Tipo nocional
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7D-3A	Moeda única	Não	Constante ou variável
D.4.1	OIS	€STR	EUR	7D-3A	Moeda única	Não	Constante ou variável
D.4.2	OIS	SONIA	DKK	7D-50A	Moeda	Não	Constante ou

					única		variável
D.4.3	OIS	SOFR	USD	7D-3A	Moeda única	Não	Constante ou variável