



Consiliul  
Uniunii Europene

Bruxelles, 9 februarie 2022  
(OR. en)

6116/22  
ADD 1

EF 44  
ECOFIN 108  
DELECT 21

## NOTĂ DE ÎNSOȚIRE

---

Sursă:	Secretara Generală a Comisiei Europene, sub semnătura dnei Martine DEPREZ, Directoare
Data primirii:	8 februarie 2022
Destinatar:	DI Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Secretarul General al Consiliului Uniunii Europene
Nr. doc. Csie:	C(2022) 619 final ANNEX
Subiect:	ANEXĂ la REGULAMENTUL DELEGAT (UE) .../... AL COMISIEI de modificare a standardelor tehnice de reglementare prevăzute în Regulamentul delegat (UE) 2015/2205 în ceea ce privește tranziția către noi indici de referință la care se raportează anumite contracte derivate extrabursiere

---

În anexă, se pune la dispoziția delegațiilor documentul C(2022) 619 final ANNEX.

---

Anexă: C(2022) 619 final ANNEX



Bruxelles, 8.2.2022  
C(2022) 619 final

ANNEX

**ANEXĂ**

**la**

**REGULAMENTUL DELEGAT (UE) .../... AL COMISIEI**

**de modificare a standardelor tehnice de reglementare prevăzute în Regulamentul delegat (UE) 2015/2205 în ceea ce privește tranziția către noi indici de referință la care se raportează anumite contracte derivate extrabursiere**

## ANEXĂ

### „ANEXĂ

Clase de instrumente financiare derivate extrabursiere pe rata dobânzii care fac obiectul obligației de compensare

*Tabelul 1*

#### Clase de swapuri de bază

ID	Tip	Indice de referință	Monedă de decontare	Scadență	Tip monedă de decontare	Opționalitate	Tip valoare noțională
A.1.1	De bază	EURIBOR	EUR	28 de zile-50 de ani	Monedă unică	Nu	Constantă sau variabilă”

*Tabelul 2*

#### Clase de swapuri pe rată fixă spre fluctuantă a dobânzii

ID	Tip	Indice de referință	Monedă de decontare	Scadență	Tip monedă de decontare	Opționalitate	Tip valoare noțională
A.2.1	Fixă spre fluctuantă	EURIBOR	EUR	28 de zile-50 de ani	Monedă unică	Nu	Constantă sau variabilă”

*Tabelul 3*

#### Clase de contracte forward pe rata dobânzii

ID	Tip	Indice de referință	Monedă de decontare	Scadență	Tip monedă de decontare	Opționalitate	Tip valoare noțională
A.3.1	FRA	EURIBOR	EUR	3 zile-3 ani	Monedă unică	Nu	Constantă sau variabilă”

*Tabelul 4*

#### Clase de swapuri pe indicii ratei dobânzii overnight

ID	Tip	Indice de referință	Monedă de decontare	Scadență	Tip monedă de decontare	Opționalitate	Tip valoare noțională
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7 zile-3 ani	Monedă unică	Nu	Constantă sau variabilă”
D.4.1	OIS	EURSTR	EUR	7 zile-3 ani	Monedă unică	Nu	Constantă sau variabilă”

D.4.2	OIS	SONIA	GBP	7 zile- 50 de ani	Monedă unică	Nu	Constantă sau variabilă”
D.4.3	OIS	SOFR	USD	7 zile- 3 ani	Monedă unică	Nu	Constantă sau variabilă”