



Europeiska  
unionens råd

Bryssel den 9 februari 2022  
(OR. en)

6116/22  
ADD 1

EF 44  
ECOFIN 108  
DELECT 21

## FÖLJENOT

---

från:	Europeiska kommissionens generalsekreterare, undertecknat av Martine DEPREZ, direktör
inkom den:	8 februari 2022
till:	Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, generalsekreterare för Europeiska unionens råd
Komm. dok. nr:	C(2022) 619 final
Ärende:	BILAGA till KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU) om ändring av de tekniska standarder för tillsyn som fastställs i delegerad förordning (EU) 2015/2205 vad gäller övergången till nya referensvärden för användning i vissa OTC-derivatkontrakt

---

För delegationerna bifogas dokument – C(2022) 619 ANNEX.

---

Bilaga: C(2022) 619 final



EUROPEISKA  
KOMMISSIONEN

Bryssel den 8.2.2022  
C(2022) 619 final

ANNEX

## **BILAGA**

**til**

### **KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU)**

**om ändring av de tekniska standarder för tillsyn som fastställs i delegerad förordning (EU) 2015/2205 vad gäller övergången till nya referensvärden för användning i vissa OTC-derivatkontrakt**

## **BILAGA**

### **”BILAGA**

Klasser av OTC-räntederivat som omfattas av clearingkravet

*Tabell 1*

#### **Klasser av basswappar**

<b>ID</b>	<b>Typ</b>	<b>Referens Index</b>	<b>Avvecklingsvaluta</b>	<b>Löptid</b>	<b>Avvecklingsvaluta Typ</b>	<b>Valfrihet</b>	<b>Teoretiskt värde Typ</b>
A.1.1	Basvärde	Euribor	EUR	28D-50Y	En enda valuta	Nej	Fast eller rörlig

*Tabell 2*

#### **Klasser av ränteswappar för fast kontra rörlig ränta (fixed-to-float)**

<b>ID</b>	<b>Typ</b>	<b>Referens Index</b>	<b>Avvecklingsvaluta</b>	<b>Löptid</b>	<b>Avvecklingsvaluta Typ</b>	<b>Valfrihet</b>	<b>Teoretiskt värde Typ</b>
A.2.1	Fixed-to-float	Euribor	EUR	28D-50Y	En enda valuta	Nej	Fast eller rörlig

*Tabell 3*

#### **Klasser av ränteterminskontrakt (FRA)**

<b>ID</b>	<b>Typ</b>	<b>Referens Index</b>	<b>Avvecklingsvaluta</b>	<b>Löptid</b>	<b>Avvecklingsvaluta Typ</b>	<b>Valfrihet</b>	<b>Teoretiskt värde Typ</b>
A.3.1	FRA	Euribor	EUR	3D-3Y	En enda valuta	Nej	Fast eller rörlig

*Tabell 4*

#### **Klasser av OIS-kontrakt (overnight index swaps)**

<b>ID</b>	<b>Typ</b>	<b>Referens Index</b>	<b>Avvecklingsvaluta</b>	<b>Löptid</b>	<b>Avvecklingsvaluta Typ</b>	<b>Valfrihet</b>	<b>Teoretiskt värde Typ</b>
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7D-3Y	En enda valuta	Nej	Fast eller rörlig
D.4.1	OIS	€STR	EUR	7D-3Y	En enda valuta	Nej	Fast eller rörlig
D.4.2	OIS	Sonia	GBP	7D-50Y	En enda valuta	Nej	Fast eller rörlig
D.4.3	OIS	Sofr	USD	7D-3Y	En enda valuta	Nej	Fast eller rörlig

