



Rat der  
Europäischen Union

Brüssel, den 13. Juni 2016  
(OR. en)

10189/16  
ADD 1

EF 187  
ECOFIN 606  
DELECT 114

### ÜBERMITTLUNGSVERMERK

---

Absender:	Herr Jordi AYET PUIGARNAU, Direktor, im Auftrag des Generalsekretärs der Europäischen Kommission
Eingangsdatum:	10. Juni 2016
Empfänger:	Herr Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Generalsekretär des Rates der Europäischen Union

---

Nr. Komm.dok.:	C(2016) 3446 final ANNEX 1
Betr.:	ANHANG der Delegierten Verordnung der Kommission zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die Clearingpflicht

---

Die Delegationen erhalten in der Anlage das Dokument C(2016) 3446 final ANNEX 1.

---

Anl.: C(2016) 3446 final ANNEX 1



Brüssel, den 10.6.2016  
C(2016) 3446 final

ANNEX 1

## **ANHANG**

**der**

**Delegierten Verordnung der Kommission**

**zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und  
des Rates durch technische Regulierungsstandards für die Clearingpflicht**

## ANHANG

der

### Delegierten Verordnung der Kommission

zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die Clearingpflicht

#### *Clearingpflichtige Kategorien von OTC-Zinsderivatekontrakten*

**TABELLE 1: KATEGORIEN VON FIXED-TO-FLOAT-ZINSSWAPS**

ID	Art	Referenzzinssatz	Abwicklungswährung	Laufzeit	Art der Abwicklungswährung	Option	Art des Nominalwerts
C.1.1	Fixed- to-Float	NIBOR	NOK	28T-10J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel
C.1.2	Fixed- to-Float	WIBOR	PLN	28T-10J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel
C.1.3	Fixed- to-Float	STIBOR	SEK	28T-15J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel

**TABELLE 2: KATEGORIEN VON FORWARD-RATE-AGREEMENTS**

ID	Art	Referenzzinssatz	Abwicklungswährung	Laufzeit	Art der Abwicklungswährung	Option	Art des Nominalwerts
C.2.1	FRA	NIBOR	NOK	3T-2J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel
C.2.2	FRA	WIBOR	PLN	3T-2J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel
C.2.3	FRA	STIBOR	SEK	3T-3J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel