



Brüssel, den 25. August 2015
(OR. en)

11509/15
ADD 1

EF 166
ECOFIN 678
DELECT 110

ÜBERMITTLUNGSVERMERK

Absender:	Herr Jordi AYET PUIGARNAU, Direktor, im Auftrag der Generalsekretärin der Europäischen Kommission
Eingangsdatum:	21. August 2015
Empfänger:	Herr Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Generalsekretär des Rates der Europäischen Union

Nr. Komm.dok.:	C(2015) 5390 final ANNEX 1
Betr.:	ANHANG zur 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(2015) 5390 final ANNEX 1.

Anl.: C(2015) 5390 final ANNEX 1



Brüssel, den 6.8.2015
C(2015) 5390 final

ANNEX 1

ANHANG

zur

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

zur

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-Zinsderivaten

TABELLE 1: KATEGORIEN VON BASISWAPS

ID	Art	Referenzzinssatz	Abwicklungswährung	Laufzeit	Art der Abwicklungswährung	Option	Art des Nominalwerts
A.1.1	Basis	EURIBOR	EUR	28T- 50J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel
A.1.2	Basis	LIBOR	GBP	28T- 50J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel
A.1.3	Basis	LIBOR	JPY	28TD- 30J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel
A.1.4	Basis	LIBOR	USD	28T- 50J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel

TABELLE 2: KATEGORIEN VON FIXED-TO-FLOAT-ZINSSWAPS

ID	Art	Referenz- zinssatz	Abwick- lungs- währung	Lauf- zeit	Art der- Abwick- lungs- währung	Op- tion	Art des Nominal- werts
A.2.1	Fixed-to-Float	EURIBOR	EUR	28T-50J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel
A.2.2	Fixed-to-Float	LIBOR	GBP	28T-50J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel
A.2.3	Fixed-to-Float	LIBOR	JPY	28TD - 30J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel
A.2.4	Fixed-to-Float	LIBOR	USD	28T-50J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel

TABELLE 3: KATEGORIEN VON FORWARD RATE AGREEMENTS

ID	Art	Referenzzinssatz	Abwicklungswährung	Laufzeit	Art der Abwicklungswährung	Option	Art des Nominalwerts
A.3.1	FRA	EURIBOR	EUR	3T- 3J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel
A.3.2	FRA	LIBOR	GBP	3T- 3J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel
A.3.3	FRA	LIBOR	USD	3T- 3J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel

TABELLE 4: KATEGORIE VON OVERNIGHT INDEX SWAPS

ID	Art	Referenzzinssatz	Abwicklungswährung	Laufzeit	Art der Abwicklungswährung	Option	Art des Nominalwerts
A.4.1	OIS	EONIA	EUR	7T-3J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel
A.4.2	OIS	FedFunds	USD	7T-3J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel
A.4.3	OIS	SONIA	GBP	7T-3J	dieselbe Währung	nein	konstant oder variabel