



Rat der
Europäischen Union

001458/EU XXVI. GP
Eingelangt am 20/11/17

Brüssel, den 17. November 2017
(OR. en)

14544/17
ADD 1

EF 286
ECOFIN 962
DELECT 225

ÜBERMITTLUNGSVERMERK

Absender:	Herr Jordi AYET PUIGARNAU, Direktor, im Auftrag des Generalsekretärs der Europäischen Kommission
Eingangsdatum:	17. November 2017
Empfänger:	Herr Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Generalsekretär des Rates der Europäischen Union

Nr. Komm.dok.:	C(2017) 7684 final ANNEX 1
Betr.:	ANHANG DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) .../... DER KOMMISSION vom 17.11.2017 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 600/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates über Märkte für Finanzinstrumente durch technische Regulierungsstandards zur Handelspflicht für bestimmte Derivate

Die Delegationen erhalten in der Anlage das Dokument C(2017) 7684 final ANNEX 1.

Anl.: C(2017) 7684 final ANNEX 1



EUROPÄISCHE
KOMMISSION

Brüssel, den 17.11.2017
C(2017) 7684 final

ANNEX 1

ANHANG

ANHANG

Der Handelspflicht unterliegende Derivate

Tabelle 1

Auf EUR lautende Fixed-to-float-Zinsswaps

Währungsreine Fixed- to-Float Zinsswaps - EURIBOR EUR 3 und 6 Monate		
Abwicklungswährung	EUR	EUR
Abwicklungsmodus	Spot (T+2)	Spot (T+2)
Option	Nein	Nein
Laufzeit	2,3,4,5,6,7,8,9,10,12,15,20,30J	2,3,4,5,6,7,10,15,20,30J
Art des Nominalwerts	Konstanter Nominalwert	Konstanter Nominalwert
Festsatzseite		
Zahlungsrhythmus	Jährlich oder halbjährlich	Jährlich oder halbjährlich
Zinsberechnungsmethode	30/360 oder act/360	30/360 oder act/360
Variable Seite:		
Referenzindex	6-Monats-EURIBOR	3-Monats-EURIBOR
Frequenz der Neufestsetzung	Halbjährlich oder vierteljährlich	Vierteljährlich
Zinsberechnungsmethode	Act/360	Act/360

Tabelle 2

Auf USD lautende Fixed-to-float-Zinsswaps

Währungsreine Fixed- to-Float Zinsswaps - LIBOR USD 3 Monate		
Abwicklungswährung	USD	USD
Abwicklungsmodus	Spot (T+2)	IMM (kommende zwei IMM-Termine)
Option	Nein	Nein
Laufzeit	2,3,4,5, 6,7,10,12,15,20,30J	2,3,4,5,6,7,10,12,15,20,30J
Art des Nominalwerts	Konstanter Nominalwert	Konstanter Nominalwert
Festsatzseite		
Zahlungsrhythmus	Jährlich oder halbjährlich	Jährlich oder halbjährlich
Zinsberechnungsmethode	30/360 oder act/360	30/360 oder act/360
Variable Seite:		
Referenzindex	LIBOR USD 3 Monate	LIBOR USD 3 Monate
Frequenz der Neufestsetzung	Vierteljährlich	Vierteljährlich
Zinsberechnungsmethode	Act/360	Act/360

Währungsreine Fixed- to-Float Zinsswaps - LIBOR USD 6 Monate		
Abwicklungswährung	USD	USD
Abwicklungsmodus	Spot (T+2)	IMM (kommende zwei IMM-Termine)
Option	Nein	Nein
Laufzeit	2,3,4,5, 6,7,10,12,15,20,30J	2,3,4,5,6,7,10,12,15,20,30J
Art des Nominalwerts	Konstanter Nominalwert	Konstanter Nominalwert
Festsatzseite		
Zahlungsrhythmus	Jährlich oder halbjährlich	Jährlich oder halbjährlich
Zinsberechnungsmethode	30/360 oder act/360	30/360 oder act/360

Variable Seite:		
Referenzindex	LIBOR USD 6 Monate	LIBOR USD 6 Monate
Frequenz der Neufestsetzung	Vierteljährlich oder halbjährlich	Vierteljährlich oder halbjährlich
Zinsberechnungsmethode	Act/360	Act/360

Tabelle 3

Auf GBP lautende Fixed-to-float-Zinsswaps

Währungsreine Fixed- to-Float Zinsswaps - LIBOR GBP 3 und 6 Monate		
Abwicklungswährung	GBP	GBP
Abwicklungsmodus	Spot (T+0)	Spot (T+0)
Option	Nein	Nein
Laufzeit	2,3,4,5,6,7,10,15,20,30J	2,3,4,5,6,7,10,15,20,30J
Art des Nominalwerts	Konstanter Nominalwert	Konstanter Nominalwert
Festsatzseite		
Zahlungsrhythmus	Vierteljährlich oder halbjährlich	Vierteljährlich oder halbjährlich
Zinsberechnungsmethode	Act/365F	Act/365F
Variable Seite:		
Referenzindex	LIBOR GBP 6 Monate	LIBOR GBP 3 Monate
Frequenz der Neufestsetzung	Halbjährlich oder vierteljährlich	Vierteljährlich
Zinsberechnungsmethode	Act/365F	Act/365F

Tabelle 4

Index-CDS

Art	Untergruppe	Geografisches Gebiet	Referenzindex	Abwicklungswährung	Serie	Laufzeit
Index-CDS	Nicht tranchierter Index	Europa	iTraxx Europe Main	EUR	On-the-run-Serie Erste Off-the-run-Serie	5J
Index-CDS	Nicht tranchierter Index	Europa	iTraxx Europe Crossover	EUR	On-the-run-Serie Erste Off-the-run-Serie	5J