



Raad van de
Europese Unie

Brussel, 13 juni 2016
(OR. en)

10189/16
ADD 1

EF 187
ECOFIN 606
DELECT 114

BEGELEIDENDE NOTA

van:	de heer Jordi AYET PUIGARNAU, directeur, namens de secretaris-generaal van de Europese Commissie
ingekomen:	10 juni 2016
aan:	de heer Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, secretaris-generaal van de Raad van de Europese Unie

Nr. Comdoc.:	C(2016) 3446 final ANNEX 1
Betreft:	BIJLAGE bij gedelegeerde verordening van de Commissie tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad met technische reguleringsnormen inzake de clearingverplichting

Hierbij gaat voor de delegaties document C(2016) 3446 final ANNEX 1.

Bijlage: C(2016) 3446 final ANNEX 1



Brussel, 10.6.2016
C(2016) 3446 final

ANNEX 1

BIJLAGE

bij

Gedelegeerde Verordening van de Commissie

tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad met technische reguleringsnormen inzake de clearingverplichting

BIJLAGE

bij

Gedelegeerde Verordening van de Commissie

tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad met technische reguleringsnormen inzake de clearingverplichting

Aan de clearingverplichting onderworpen klassen van otc-rentederivaten

TABEL 1: KLASSEN VAN SWAPS VAN VASTE VOOR VARIABELE RENTE

id	Type	Referentie index	Afwikkelings valuta	Looptijd	Afwikkelings valuta type	Optionaliteit	Notioneel
C.1.1	vast voor variabel	NIBOR	NOK	28D-10Y	Eén valuta	neen	Constant of variabel
C.1.2	Vast voor variabel	WIBOR	PLN	28D-10Y	Eén valuta	neen	Constant of variabel
C.1.3	Vast voor variabel	STIBOR	SEK	28D-15Y	Eén valuta	neen	Constant of variabel

TABEL 2: KLASSEN VAN RENTETERMIJNCONTRACTEN (FORWARD RATE AGREEMENTS)

id	Type	Referentie index	Afwikkelings valuta	Looptijd	Afwikkelings valuta type	Optionaliteit	Notioneel
C.2.1	FRA	NIBOR	NOK	3D-2Y	Eén valuta	neen	Constant of variabel
C.2.2	FRA	WIBOR	PLN	3D-2Y	Eén valuta	neen	Constant of variabel
C.2.3	FRA	STIBOR	SEK	3D-3Y	Eén valuta	neen	Constant of variabel