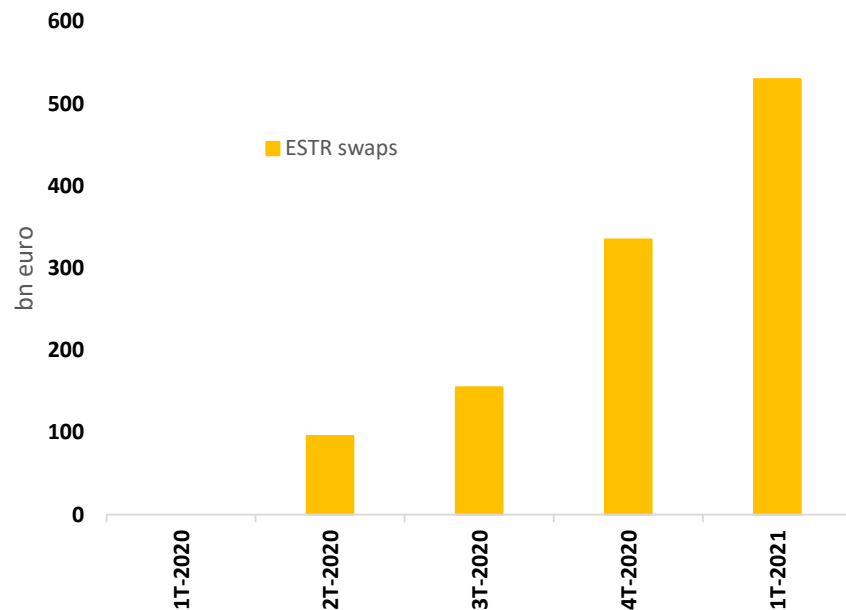
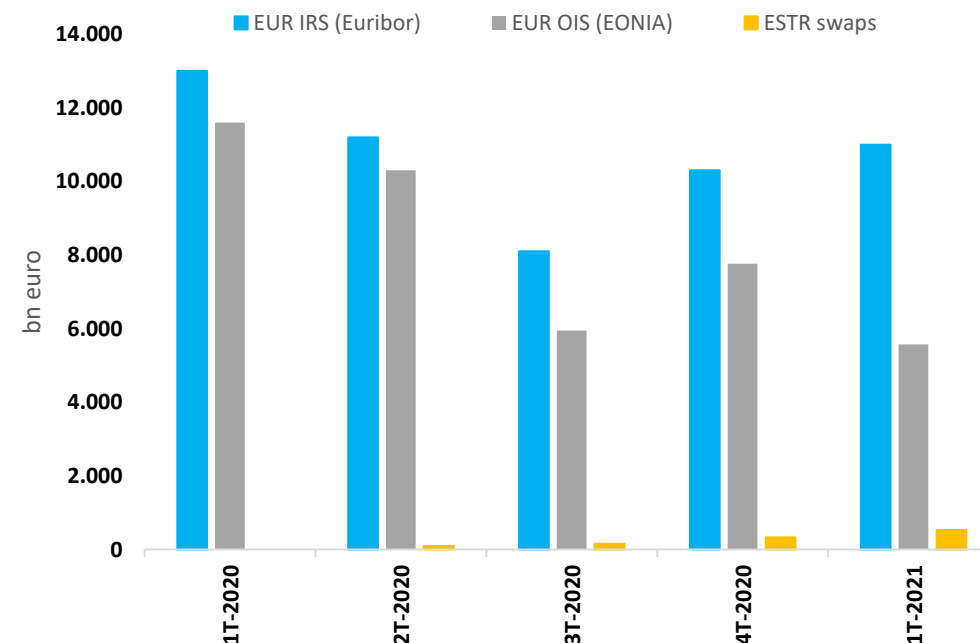


Volumen en EUR IRS (Euribor), EUR OIS (Eonia) y €STR swaps

Evolución del volumen de derivados contratados en €str
(nocial contratado por trimestre)



Evolución del volumen de derivados sobre Euribor, Eonia y €str
(nocial contratado por trimestre)



Fechas clave para la **sustitución del Eonia por el €str**:

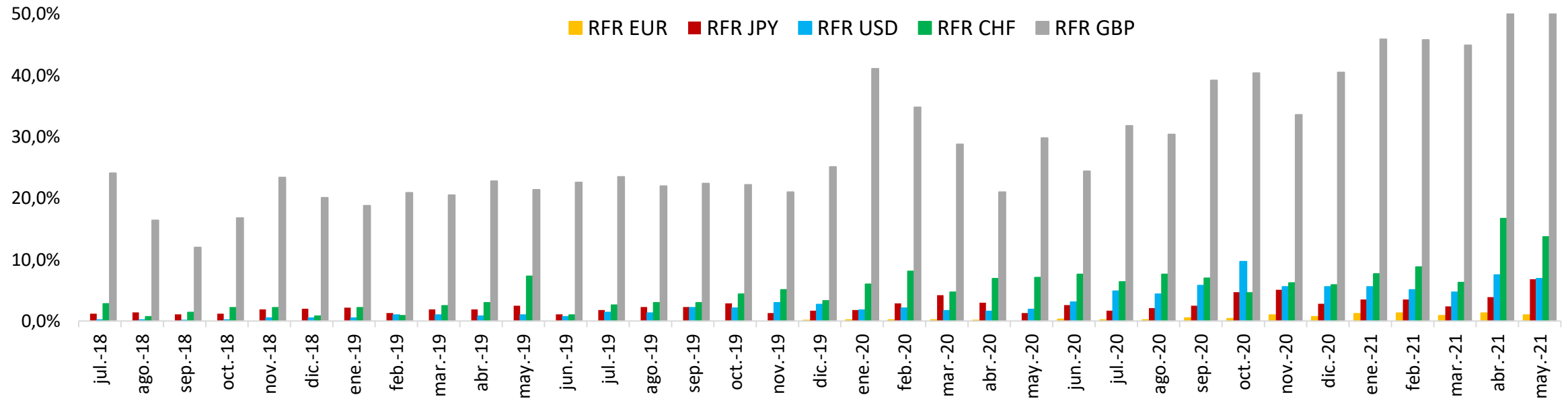
- **15-oct-21**: Las cámaras de compensación convertirán a €str los contratos vivos indexados a Eonia
- **3-ene-22**: Última publicación del EONIA

Fuente y notas: <https://www.clarusft.com/cleared-swap-volumes-and-share-1q-2021/>

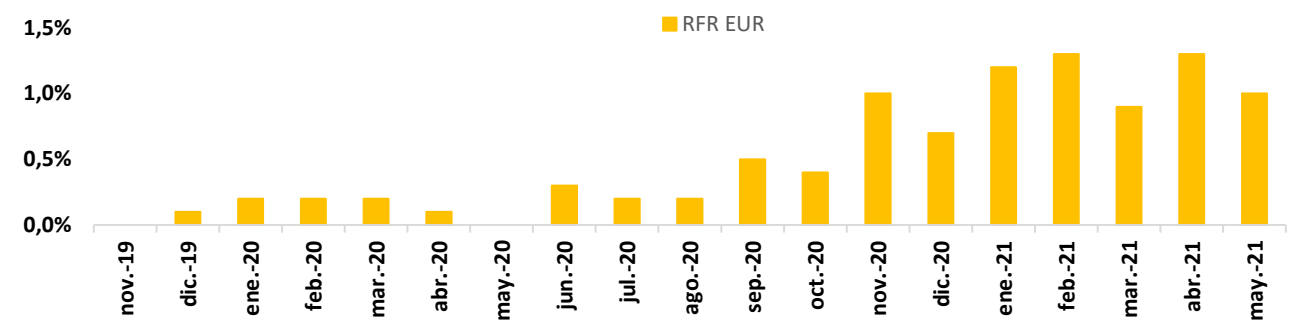
Single-sided notional in euro bn. Datos trimestrales. EUR IRS: solamente EUR IRS sin OIS, Basis, ZC, VNS and FRAs (LCH SwapClear Ltd, Eurex, CME (OTC) y BME). EUR OIS (EONIA): Overnight Index Swaps referenciados a EONIA o €STR (LCH SwapClear Ltd, Eurex, CME (OTC)), restando €STR swaps. €STR swaps: swaps referenciados a €STR, tanto OIS como Basis (LCH SwapClear Ltd y Eurex).

Evolución de la contratación de derivados sobre RFR como % de la contratación de derivados en cada divisa

% de volumen en RFR en términos de sensibilidad (DV01)



% de volumen en RFR en términos de sensibilidad (DV01)



Fuente y notas: ISDA-Clarus RFR adoption indicator, <https://rfr.clarusft.com/>

The ISDA-Clarus RFR Adoption Indicator monitors how much derivatives trading activity is being conducted in risk-free rates (RFRs). It covers six currencies - USD, EUR, JPY, GBP, AUD and CHF.

We calculate the risk-weighted amount of activity (DV01) across all interest rate derivatives, and publish the percentage of activity that was transacted in RFRs.