

III. Departement

Börsenstrasse 15
Postfach, CH-8022 Zürich
Telefon +41 58 631 77 00
Fax +41 58 631 50 71
www.snb.ch

Zürich, 17. Dezember 2020

Geldmarkt

Ausschluss Libor-basierter Floating-Rate Notes aus dem Kreis der SNB-repofähigen Effekten

Sehr geehrte Damen und Herren

Die Libor-Fixierungen in Franken und anderen Währungen (mit Ausnahme von gewissen Laufzeiten in US-Dollar) werden voraussichtlich Ende 2021 eingestellt. Die Schweizerische Nationalbank (SNB) unterstützt die Marktteilnehmer bei der Transition zu neuen, robusteren Referenzzinssätzen wie SARON und reduziert mögliche Risiken, die mit dem Wegfall des Libors einhergehen. Aus diesem Grund wird die SNB per Ende 2021 sämtliche Libor-basierten Floating-Rate Notes in allen Währungen aus dem Kreis der SNB-repofähigen Effekten ausschliessen. Floating-Rate Notes, deren Verzinsung von anderen Referenzzinssätzen bestimmt wird, verbleiben im Verzeichnis der SNB-repofähigen Effekten.

Die Anpassung betrifft wenige Effekten und das potentiell einsetzbare Volumen an SNB-repofähigen Effekten wird dadurch nur geringfügig kleiner. Der Ausschluss der betroffenen Effekten wird in der Mutationen-Abfrage per Ende 2021 ersichtlich sein.

Freundliche Grüsse
Schweizerische Nationalbank

Marcel Zimmermann
Leiter Geldmarkt und Devisenhandel

Roman Baumann
Leiter Geldmarkt