Preisliste – Verwendung der Swiss Reference Rates (SRR) für abgeleitete Daten und Benchmarks sowie Trademark mit externer Weiterverteilung für Datenvendoren und Finanz-/Nicht-Finanzinstitutionen

Version 5 vom 1. Juli 2026

Sensitivity: C1 Public

Die nachfolgenden Gebühren sind gültig per 1. Januar 2021

Indexpaket	Inhalt (beinhaltete Indizes und Rates für das Indexpaket)	Erlaubter Zweck	Anzahl Indizes	Gebührenansatz für Daten-vendoren	Gebührenansatz für Finanz- & Nicht-Finanzinstitutionen
Swiss Reference Rates	Es sind dies beispielsweise der Overnight Rate SARON, der SARON Index (SAION) und die SARON Compound Rates	Abgeleitete Daten[1] (z.B. Derived Data)		CHF 32'000 p.a.	CHF 24'000 p.a.
		Berechnungen für einen compounded SARON[2]		Kostenlos	Kostenlos
		Abgeleitete Benchmarks[3] (z.B. Indexberechnungen)	1-10 Indizes 11-25 Indizes Unlimitiert	CHF 10'000 p.a. CHF 18'000 p.a. CHF 24'000 p.a.	CHF 7'500 p.a. CHF 13'500 p.a. CHF 18'000 p.a.
		Trademark[4] Verwendung		CHF 32'000 p.a.	CHF 32'000 p.a.

Bitte beachten Sie: Alle oben genannten erlaubten Zwecke und die damit verbundenen Gebühren beziehen sich ausschliesslich auf die externe Weiterteilung. Für die interne Verwendung der SRR ist die "Preisliste – Swiss Reference Rates (SRR)" für Finanz- und Nicht-Finanzinstitutionen massgebend. Zudem liefert das Dokument "FAQ zur Indexlizenzierung – Swiss Reference Rates (SRR) " Antworten zu häufig gestellten Fragen.

[1]Abgeleitete Daten

Abgeleitete Daten im Zusammenhang mit SRR können als Indexdaten definiert werden, die ganz oder teilweise aus den SRR-Daten erstellt, validiert oder berechnet oder mit ihnen verglichen wurden und die nicht aus den Originaldaten oder der Originalquelle identifiziert oder leicht in diese zurückgeführt werden können. Es spielt dabei keine Rolle, ob tagesaktuelle (restriktive) oder historische/verzögerte (frei verfügbare) SRR-Daten verwendet werden. Beispiele hierfür sind die Erstellung und Verteilung von Forward-Rate- und Renditekurven, die als Ankerpunkt für die Berechnung von aufgelaufenen Zinsschulden, zur Durchführung von Analysen für festverzinsliche Wertpapiere und zur Bewertung von Swap-Positionen dienen. Die Verwendung und Verteilung abgeleiteter Daten in Portfolio- und Analyseprodukten, für die Risikoanalyse, die Performance-Attribution und für die Bewertung und Preisfestsetzung von festverzinslichen Anlageklassen oder die Erstellung einer CHF-Overnight-Zinsswapkurve, um sie für die Diskontierung von Cashflows und die Bewertung von indexierten CHF-Overnight-Swaps sowie für die Berechnung von Analysen für besicherte CHF-Swaps zu verwenden, sind ebenfalls Beispiele für abgeleitete Daten.

[2]Berechnung und externe Weiterverteilung eines compounded SARON

Die Berechnung und externe Weiterverteilung eines compounded SARON ist wie folgt zulässig:
SARON Compound Rates und SARON Compound Indizes werden von der SIX zur Verfügung gestellt, compounded Rates können aber auch vom Datenvendor/Finanz-/Nicht-Finanzinstitut berechnet werden; in diesem Fall werden sie als Berechnungen für einen compounded SARON bezeichnet. Die geistigen Eigentumsrechte an den SARON Compound Rates und Indizes verbleiben bei der SIX. Der Datenvendor/die Finanz-/Nicht-Finanzinstitution stellt die SARON Compound Rates, die SARON Compound Indizes sowie die Berechnungen für einen compounded SARON mit weniger als einem Handelstag Verzögerung nur autorisierten Empfängern (Lizenznehmern von SRR) und nur in Übereinstimmung mit den Genehmigungsrichtlinien zur Verfügung. Alle SARON Compound Rates und Indizes sowie alle Berechnungen

Sensitivity: C1 Public

für einen compounded SARON, die älter als ein Handelstag sind, können ohne Einschränkung öffentlich verteilt werden.

[3]Abgeleitete Benchmarks

Abgeleitete Benchmarks im Zusammenhang mit SRR können definiert werden als die Verwendung von SRR-Daten zur Berechnung und Verteilung von Indizes/Benchmarks (unabhängig davon, ob es sich um tagesaktuelle (restriktive) oder historische/verzögerte (frei verfügbare) SRR-Daten handelt), wobei der jeweilige Index/Benchmark ganz oder teilweise auf den SRR-Daten basiert. Beispiele für abgeleitete Benchmarks umfassen die Indexberechnung unter Verwendung der SRR als Komponente.

[4]Trademark Verwendung

Die Trademark Verwendung im Zusammenhang mit SRR bezeichnet die Nutzung der eingetragenen Marke „SARON" ausschliesslich zur Kennzeichnung von Finanzinstrumenten oder anderen Produkten ohne direkte Verwendung der SRR-Daten. Beispiele sind Zinsdatenlösungen mit Referenz auf SARON wie Zinskurven, Alternative Reference Rates, Interest Rate Swaps, Overnight Index Swaps, etc.

Sensitivity: C1 Public