

## SIX Swiss Exchange Mitteilung Nr. 21/2022

Titel	<b>Kotierung, Handel und Abwicklung von Floating Rate Notes auf Referenzzinssätzen in USD, EUR und GBP ab 8. August 2022</b>
Kategorie	Handel und Produkte
Autorisiert durch	Alain Picard, Head Products Rebecca Stasolla, Head Change Delivery
Seiten	3
Datum	18.07.2022

Information 

Inhalt dieser Mitteilung:

- Kotierung, Handel und Abwicklung von **Floating Rate Notes (FRN) auf Referenzzinssätzen** in zusätzlichen Währungen ab **8. August 2022**
- Keine Anpassung in den Emittenten- und Handelsregularien von SIX Swiss Exchange AG
- Testphase in der Membertest-Umgebung mit dedizierten Test-Instrumenten
- Einführung in der Membertest-Umgebung am **25. Juli 2022** und in der Produktions-Umgebung am **8. August 2022** geplant

Die Schweizer Börse freut sich, die Emittenten und Teilnehmer über **die Erweiterung der Produktpalette im Anleihensmarkt ab 8. August 2022** zu informieren.

### Floating Rate Notes auf Referenzzinssätzen

Seit der Einführung von [SWXess Maintenance Release 9.1](#) (SMR9.1) im Juni 2021 bietet SIX Swiss Exchange AG Kotierung, Handel und Abwicklung von Floating Rate Notes (FRNs) auf dem Schweizer Franken (CHF) Referenzzinssatz [SARON](#) (Swiss Average Rate Overnight) an.

Ab dem 8. August 2022 bietet die Schweizer Börse auf Wunsch der Teilnehmer neu auch Kotierung, Handel und Abwicklung von Floating Rate Notes (FRNs) auf den folgenden Referenzzinssätzen an:

Währung	Referenzzinssatz
United States Dollar (USD)	<a href="#">SOFR</a> - Secured Overnight Financing Rate
European Euro (EUR)	<a href="#">€STR</a> - Euro Short-Term Rate
Great Britain Pound (GBP)	<a href="#">SONIA</a> - Sterling Overnight Index Average

Die Kotierung von Floating Rate Notes (FRNs) auf Referenzzinssätzen in allen unterstützten Währungen kann ausschliesslich über [CONNEXOR](#) beantragt werden. Weitere Informationen finden Sie in der [Connexor Service Notice No. 08/2022](#).

Der Handel und die Abwicklung der FRNs in USD, EUR und GBP erfolgen nach den Regeln des Handelssegments «Anleihen – Nicht CHF» gemäss Anhang O [Wegleitung Handelsparameter](#).

Die Berechnung der Marchzinsen für die Floating Rate Notes (FRNs) in USD, EUR und GBP basiert auf dem gleichen Prinzip wie Produkte auf dem Referenzzinssatz SARON (Observation Period mit „Shift“ und nicht „Lag“) und ist in Ziffer 3.1.6 der [SMR9.1 – Participant Readiness](#) Broschüre (Englisch) näher beschrieben.

## Handelsregularien

Die Einführung von Floating Rate Notes (FRNs) auf den Referenzzinssätzen in USD, EUR und GBP hat keinen Einfluss auf die Emittenten- und Handelsregularien von SIX Swiss Exchange AG. Die geltenden Regularien finden Sie unter folgenden Links:

- [Emittentenregularien](#)
- [Handelsregularien](#)

## Spezifikationen der SWXess-Schnittstellen

Die Einführung von Floating Rate Notes (FRNs) auf Referenzzinssätzen in USD, EUR und GBP hat keinen Einfluss auf die Handels-, Referenz- und Marktdaten-Schnittstellen der SWXess Handelsplattform und erfordert keine zwingenden Anpassungen seitens der Teilnehmer, ISV und ASP.

Die gültigen Spezifikationen der SWXess-Schnittstellen finden Sie in der [Member Section](#) der Schweizer Börse.

## Einführung

Für die Einführung in der Membertest- und Produktions-Umgebung sind folgende Termine geplant:

Datum	Aktivität
25. Juli 2022	Einführung und voraussichtlich erster Handelstag <b>in der Membertest</b> -Umgebung
8. August 2022	Einführung und voraussichtlich erster Handelstag <b>in der Produktions</b> -Umgebung
15. August 2022	<b>Ausweichtermin</b> für die Einführung und voraussichtlich erster Handelstag in der Produktions-Umgebung

Für die Einführung von Floating Rate Notes auf Referenzzinssätzen in USD, EUR und GBP sind keine Migrationsaktivitäten auf Seiten der Teilnehmer notwendig und der Upgrade der betroffenen SWXess-Applikationen ist transparent.

## Testphase

Die Schweizer Börse wird das Testen der neuen Floating Rate Notes (FRNs) auf Referenzzinssätzen in USD, EUR und GBP während der Membertest-Phase unterstützen, indem dedizierte Instrumente zum Testen bereitgestellt werden. Beachten Sie, dass diese Instrumente nur zum Testen bestimmt sind und in der Produktionsumgebung nicht verfügbar sein werden. Nachfolgend finden Sie die relevanten Informationen zu den Test-Instrumenten:

Attribut	FRN in USD	FRN in EUR	FRN in GBP
ISIN (isin)	US1111133336	DE1111111115	GB1111122229
Währung (tradingCurrency)	USD	EUR	GBP
Markt (securityExchange)	XSWX	XSWX	XSWX
Erster Handelstag (firstTradingDate)	25.07.2022	25.07.2022	25.07.2022
Letzter Handelstag (lastTradingDate)	04.08.2022	04.08.2022	04.08.2022
Instrumenttyp (securityTypeCode)	RF	RF	RF

Attribut	FRN in USD	FRN in EUR	FRN in GBP
Handelssegment (tradingSegmentID)	581	581	581
Abwicklungssegment (clearingSettlementSegmentCode)	IBNC	IBNC	IBNC

Sollten Sie Fragen zu Kotierung, Handel und Abwicklung von Floating Rate Notes (FRNs) auf Referenzzinssätzen haben oder weitere Informationen wünschen, wenden Sie sich bitte an Ihren [Ansprechpartner für Anleihen](#).

SIX Swiss Exchange AG ist fortwährend bemüht, ihr Dienstleistungs- und Produktangebot sowie die SWXess-Handelsplattform zu erweitern und zu verbessern. Unsere Teilnehmer können dabei von den Verbesserungen profitieren, die fortwährende Effizienz für den Handel an der Börse gewährleisten.

**Für Fragen steht Ihnen Member Services gerne zur Verfügung:**

**Telefon:** +41 58 399 2473

**E-Mail:** [member.services@six-group.com](mailto:member.services@six-group.com)

Links zu SIX Swiss Exchange AG:

[www.six-group.com](http://www.six-group.com) | [Member Section](#) | [Formulare](#) | [Reglemente](#) | [Weisungen](#)