



Merkblatt «Eidgenossen Lending Facility»

Die Bundestresorerie bietet Teilnehmern des Schweizer Repo-Marktes via Repogeschäfte Zugang zu [Eidgenössischen Anleihen im Eigenbestand](#) (nachfolgend «Eidgenossen Lending Facility»). Dieses Merkblatt beschreibt die Bedingungen für den Zugang zur Eidgenossen Lending Facility.

1. Teilnahmevoraussetzungen

Der Zugang zur Eidgenossen Lending Facility setzt voraus:

- a) Status als Teilnehmer des Schweizer Repo-Marktes (gemäss der zum Zeitpunkt des Geschäftsabschlusses geltenden Mitgliederliste der SIX Repo AG);
- b) interne Freigabe des Teilnehmers durch die Bundestresorerie; und
- c) die gegenseitige Freischaltung auf der SIX CO:RE Handelsplattform.

Für das Onboarding wenden sich interessierte Teilnehmer via Telefon (+41 58 465 14 80) oder Bloomberg Chat an das [Front Office der Bundestresorerie](#).

Die Bundestresorerie kann Gegenparteien ohne Angabe von Gründen jederzeit vom Zugang zur Eidgenossen Lending Facility ausschliessen.

2. Abschlussvorbehalt

Es besteht kein Anspruch auf Handelsabschluss.

3. Anfragen und Handelszeiten

Teilnahmeberechtigte Gegenparteien gemäss Ziffer 1 können täglich zwischen 9.30 Uhr und 10.30 Uhr Anfragen via SIX CO:RE, Telefon (+41 58 465 14 80) oder Bloomberg Chat an das [Front Office der Bundestresorerie](#) stellen. Ausgenommen sind die Feiertage für CHF-Geschäfte der SIX Repo AG. Zudem steht die Eidgenossen Lending Facility jeweils am Auktionstag Eidgenössischer Anleihen (i.d.R. der zweite Mittwoch des Monats, siehe [Auktionskalender der Bundestresorerie](#)) nicht zur Verfügung.

4. Limiten

Das Minimumvolumen pro Handelsabschluss beträgt CHF 10 Millionen. Zudem haben teilnahmeberechtigte Gegenparteien Zugang zu maximal CHF 100 Millionen einer einzelnen Eidgenössischen Anleihe via die Eidgenossen Lending Facility.

5. Kontraktarten

Es stehen folgende Kontraktarten der SIX Repo AG zur Verfügung:

| ID | Währung | Term | Collateral | Rate Type | Terminable on demand |
|--------------|---------|--|---------------|-----------|----------------------|
| CH0008259993 | CHF | SPC, min. ON, max. 3 Monate bzw. 2 Wochen vor Coupondatum der jeweiligen Eidgenössischen Anleihe | CHF Cash | Fixed | Nein |
| CH0008260009 | CHF | NON, min. ON, max. 3 Monate bzw. 2 Wochen vor Coupondatum der jeweiligen Eidgenössischen Anleihe | CHF Cash | Fixed | Nein |
| Linked | CHF | NON, min. ON, max. 3 Monate bzw. 2 Wochen vor Coupondatum der jeweiligen Eidgenössischen Anleihe | SNB GC Basket | Fixed | Nein |

6. Indikative Konditionen

Die Eidgenossen Lending Facility steht zu den nachfolgend genannten indikativen Konditionen zur Verfügung. Diese indikativen Konditionen können jederzeit und ohne schriftliche Vorankündigung angepasst werden.

| Kontraktart | Indikative Konditionen |
|--|---------------------------------------|
| Eidgenössische Anleihe gegen Cash | Abschlag von 25bp p.a. zu CHF OIS Mid |
| Eidgenössische Anleihe gegen SNB GC (Linked) | Lending Fee von 20bp p.a. |

7. Handelsabschluss

Der Handelsabschluss erfolgt über die SIX CO:RE Handelsplattform.

8. Hinweis

Die Bundestresorerie kann die vorliegenden Bedingungen jederzeit und ohne Vorankündigung ändern.