

Erweiterte Liquiditätsfazilität (ELF)

Berichterstattung zu Liquidität gegen Wertschriften (LGWS)

ERLÄUTERUNGEN

I. MERKMALE DER ERHEBUNG

ERHEBUNGSGEGENSTAND

Erhoben werden von der SNB zugelassene Sicherheiten für Bezüge von Liquidität gegen Wertschriften im Rahmen der ELF. Grundlage bilden die ELF-Vertragsdokumentation und insbesondere die ELF-Bedingungen zu den Sicherheiten für LGWS (ELF-Teilnahmeerklärung, Anhang 6). Im Fall von Widersprüchen zwischen diesen Erläuterungen und der ELF-Vertragsdokumentation geht die ELF-Vertragsdokumentation vor.

ERHEBUNGSSTUFE

Die Erhebung erfolgt auf der Erhebungsstufe «Unternehmung». Auf der Erhebungsstufe Unternehmung meldet jede an der ELF teilnehmende Bank ihre eigenen Geschäfte, konsolidiert mit denjenigen ihrer Filialen im In- und Ausland.

AUSKUNFTSPFLICHT

Meldepflichtig sind alle Banken, denen die SNB die ELF-Fähigkeit für LGWS attestiert hat.

PERIODIZITÄT

Monatlich, mit Stichtag Ende Monat.

EINREICHEFRIST

Die Einreichfrist beträgt 23 Tage nach dem Stichtag.

II. ALLGEMEINE ERLÄUTERUNGEN

BESTANDSGRÖSSEN

Bestandsgrößen sind zum Wert am Monatsende zu melden.

VORZEICHENKONVENTION

Positionen werden grundsätzlich ohne Vorzeichen gemeldet. Dies gilt auch für die Minusposition «Abschlüsse».

III. ERLÄUTERUNGEN ZU DEN ERHOBENEN POSITIONEN

TOTAL WERTSCHRIFTEN

Summe aller ausstehenden Wertschriften (Handelsbestand und Eigenbestand).

GEBUNDEN DURCH

Fazilitäten der SNB

Wertschriften sind durch Fazilitäten der SNB gebunden, wenn sie permanent eingeliefert sind oder bezogene Darlehen besichern.

Fazilitäten ausländischer Zentralbanken

Wertschriften sind durch Fazilitäten ausländischer Zentralbanken gebunden, wenn sie permanent eingeliefert sind oder bezogene Darlehen besichern.

UNGEBUNDENE WERTSCHRIFTEN

Ungebundene Wertschriften müssen die folgenden Eigenschaften haben:

- sie müssen im unbeschränkten und unbelasteten Eigentum der Pfandgeberin stehen;
- sie und die mit ihnen verknüpften Rechte dürfen nicht mit dinglichen Rechten Dritter belastet sein;
- die Pfandgeberin ist über die Wertschriften vollumfänglich Verfügungsberechtigt, und deren Verpfändung ist für sie bindend und gegen sie durchsetzbar;
- sie dürfen nicht bei einer Zentralbank zur permanenten Deckung einer Limite voreingeliefert oder deponiert sein;
- sie müssen bei SIX SIS verwahrt oder innert zwei Tagen zu SIX SIS transferierbar sein;
- sie dürfen nicht in den operativen Betrieb eingebunden oder für die Aufrechterhaltung des operativen Betriebs notwendig sein.

FÜR LGWS ZUGELASSEN

Wertschriften, welche die Anforderungen gemäss ELF-Bedingungen zu den Sicherheiten für LGWS erfüllen.

HQLA (HIGH-QUALITY LIQUID ASSETS)

HQLA (hochwertige liquide Aktiva) sind lastenfreie Vermögenswerte von hoher Kreditqualität, gemäss Liquiditätsverordnung (LiqV; SR 952.06).

NON-HQLA

Lastenfreie Vermögenswerte, welche die Kriterien an HQLA nicht erfüllen.

REGULATORISCHER HQLA-ÜBERSCHUSS

Vorhandene HQLA minus Nettomittelabflüsse gemäss LCR-Berechnung (Stichtag Monatsende). Für systemrelevante Banken erfolgt die Berechnung gemäss den «Besonderen Bestimmungen für systemrelevante Banken» in der Liquiditätsverordnung.

GOVERNMENT BONDS (STAATSANLEIHEN)

Schuldverschreibungen, die von einer nationalen Regierung oder von untergeordneten Gebietskörperschaften zur Finanzierung öffentlicher Ausgaben ausgegeben werden, sowie Schuldverschreibungen von Zentralbanken und Supranationalen Institutionen.

COVERED BONDS (PFANDBRIEFE)

Schuldverschreibungen, die von Banken ausgegeben werden und durch einen speziellen Pool hochwertiger Vermögenswerte, typischerweise Hypotheken oder öffentliche Kredite, gedeckt sind und weiterhin in der Bilanz des Emittenten verbleiben. Hierzu zählen insbesondere auch von Pfandbriefinstituten emittierte Schuldverschreibungen.

CORPORATE BONDS (UNTERNEHMENSANLEIHEN)

Schuldinstrumente, die von Unternehmen zur Kapitalaufnahme ausgegeben werden und den Emittenten verpflichten, Zinsen zu zahlen und den Nominalwert bei Fälligkeit zurückzuzahlen. Der Emittent einer Anleihe und dessen Muttergesellschaft dürfen keine Schweizer Banken sein.

ABS, MBS, CMO

Asset-Backed Securities (ABS), Mortgage-Backed Securities (MBS) und Collateralized Mortgage Obligations (CMO) sind strukturierte Wertpapiere, die durch Pools finanzieller Vermögenswerte wie Kredite oder Hypotheken gedeckt sind, wobei die Zahlungsflüsse aus den zugrunde liegenden Vermögenswerten gemäss einer definierten Struktur an die Investoren weitergeleitet werden.

EQUITIES (AKTIEN)

Eigentumsanteile an einem Unternehmen, die einen Anspruch auf dessen Vermögenswerte und Erträge repräsentieren.

Aktien müssen Bestandteil des MSCI World Indexes sein. Nicht zulässig sind Aktien von Schweizer Banken.

LIQUIDITÄTSWERT

Der Liquiditätswert einer Wertschrift, welcher dafür massgebend ist, in welchem Umfang eine Wertschrift zur Besicherung berücksichtigt wird, ergibt sich aus dem Marktwert einer Wertschrift abzüglich der anzuwendenden SNB-Abschläge gemäss den ELF-Bedingungen zu den Sicherheiten für LGWS.

Herausgeberin

Schweizerische Nationalbank
Statistik
Postfach, CH-8022 Zürich
Telefon +41 58 631 00 00

Fragen zu Datenlieferungen

esurvey.support@snb.ch

Fragen zu Erhebungen

statistik.erhebungen@snb.ch

Sprachen

Deutsch und Französisch

Herausgegeben

Im August 2026

Verfügbarkeit

Die Formulare, Erläuterungen sowie weitere Informationen zu den Erhebungen der Schweizerischen Nationalbank sind im Internet verfügbar unter www.snb.ch, Die SNB/Statistik/Erhebungen/ Erhebungsmittel.