

## Regelung betreffend zusätzlicher Liquidität (Innertageskredit und Übernachtkredit)

SECB stellt ihren Kunden zusätzliche Liquidität, derzeit einschließlich kostenlosem Kapitalsdienst, wie folgt zur Verfügung:

### 1. INNERTAGESKREDIT-FAZILITÄT

Die SECB gewährt ihren EUR-Clearing Kunden Innertageskredite gegen uneingeschränkte Verpfändung von zentralbankfähigen Sicherheiten, die dem von der Europäischen Zentralbank (EZB) veröffentlichten Verzeichnis der Kategorie-I Sicherheiten bzw. Kategorie-II Sicherheiten der Deutschen Bundesbank (vgl. nachfolgend Ziff. 3) entsprechen ([www.ecb.int](http://www.ecb.int) section „MFIs and assets“). Die Verpfändung der Sicherheiten erfolgt bei Clearstream (vormals Deutsche Börse Clearing AG), Frankfurt am Main zugunsten der SECB. Die tägliche Bewertung der Sicherheitenbestände erfolgt seitens XEMAC, dem Collateral Management System von Clearstream, gemäß den Anforderungen des ESZB für deren Spitzenrefinanzierungsfazilität. Der aktuelle Beleihungswert der Sicherheitenbestände wird zu Beginn eines jeden Clearingtages dem jeweiligen SECB-Girokonto **vollumfänglich** gutgeschrieben und anschliessend auf das euroSIC-Verrechnungskonto des euroSIC Teilnehmers transferiert. Am Ende des Clearingtages wird der Innertageskredit dem jeweiligen SECB-Girokonto wieder belastet.

### 2. ÜBERNACHTKREDIT-FAZILITÄT

Gerät ein SECB-Girokonto durch die Belastung des Innertageskredites in Überzug wird in Höhe des Überzugs ein Übernachtkredit gewährt, maximal jedoch nur bis zur Höhe des Innertageskredites. Der Überzug wird dem SECB-Übernachtkreditkonto des euroSIC-Teilnehmers belastet. Zur Deckung des Übernachtkredites werden die gleichen Sicherheiten herangezogen, die zur Deckung des vorher zurückgeführten Innertageskredites dienten. Am nächsten Clearingtag wird der Übernachtkredit dem jeweiligen SECB-Girokonto wieder belastet und dem SECB-Übernachtkreditkonto gutgeschrieben. Für das Übernachtkreditkonto wird von SECB ein monatlicher Zinsabschluss erstellt. Der Basiszinssatz für den Übernachtkredit richtet sich nach dem Zinssatz der Spitzenrefinanzierungsfazilität des ESZB. Diesem wird eine von SECB festgelegte Marge zugeschlagen. Die Zinsberechnung erfolgt nach der Eurozinsmethode (Actual/360).

### 3. Refinanzierungsfähige Sicherheiten

Kriterien	ECB Kategorie I (EWU-Raum)	NCB Kategorie II (National)
<b>Art der Sicherheit</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• ESZB-Schuldverschreibungen;</li> <li>• Sonstige marktfähige Schuldtitel (ausser „hybriden“ Sicherheiten).</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Marktfähige Schuldtitel</li> <li>• Nicht marktfähige Schuldtitel</li> <li>• An einem geregelten Markt gehandelte Aktien.</li> </ul>
<b>Abwicklungsverfahren</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Die Sicherheiten müssen zentral in girosammelverwahrfähiger Form bei nationalen Zentralbanken oder einer zentralen Wertpapierverwahrungsstelle hinterlegt werden, die den EZB-Mindeststandards entspricht.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Die Sicherheiten müssen der nationalen Zentralbank, die sie in ihr Kategorie-II-Verzeichnis aufgenommen hat, leicht zugänglich sein.</li> </ul>
<b>Emittenten</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• ESZB;</li> <li>• Öffentliche Hand;</li> <li>• Privater Sektor;</li> <li>• internationale und supranationale Institutionen.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Öffentliche Hand;</li> <li>• Privater Sektor.</li> </ul>
<b>Bonitätsanforderung</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Der Emittent (Garant) muss von der EZB als bonitätsmässig einwandfrei eingestuft worden sein.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Der Emittent/Schuldner (Garant) muss von der nationalen Zentralbank, die die Sicherheit in ihr Kategorie-II-Verzeichnis aufgenommen hat, als bonitätsmässig einwandfrei eingestuft worden sein.</li> </ul>
<b>Sitz des Emittenten (ohne Garanten)</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• EWR</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Euro-Währungsraum</li> </ul>
<b>Hinterlegung der Sicherheit</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Euro-Währungsraum</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Euro-Währungsraum</li> </ul>
<b>Währung</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Euro</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Euro</li> </ul>
<b>Nachrichtlich: Grenzüberschreitende Nutzung</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Ja</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Ja</li> </ul>