

# PRESSEMITTEILUNG

31. Mai 2019

## EZB stellt einmaligen Zinsaufschlag zwischen €STR und EONIA zur Verfügung

- Spread zwischen €STR und EONIA auf 0,085 % (8,5 Basispunkte) festgesetzt
- Berechnungsmethodik basiert auf Empfehlungen der Arbeitsgruppe zu risikofreien Euro-Zinssätzen
- Spread soll vom EMMI in der neuen EONIA-Methodik ab 2. Oktober 2019 verwendet werden
- ISIN für €STR lautet EU000A2X2A25 (FISN: ECB/EUR EURO SHORT-TERM RATE IR)

Die Europäische Zentralbank (EZB) hat den Spread zwischen €STR und EONIA auf Basis der Methodik berechnet, die von der Arbeitsgruppe zu risikofreien Euro-Zinssätzen empfohlen und vom European Money Market Institute (EMMI) zur Rekalibrierung der EONIA-Methodik ab dem 2. Oktober 2019 und bis zu ihrer Außerkraftsetzung durch das EMMI übernommen wird. Die EZB hat diesen Spread auf der Grundlage der im Zeitraum vom 17. April 2018 bis zum 16. April 2019 verzeichneten EONIA- und Pre-€STR-Tageswerte auf 0,085 % (8,5 Basispunkte) festgesetzt. Die internationale Wertpapieridentifikationsnummer (ISIN) für €STR lautet EU000A2X2A25, die Kurzbezeichnung (Financial Instrument Short Name – FISN) lautet ECB/EUR EURO SHORT-TERM RATE IR.

**Medianfragen sind an Herrn [William Lelieveldt](#) zu richten (Tel. +49 69 1344 7316).**

### Anmerkung

Auch nach Einführung des €STR besteht der EONIA fort, und zwar im Rahmen einer neuen Methodik, die direkt Bezug zum €STR nimmt. Auf diese Weise kann der EONIA für einen begrenzten Zeitraum in bestehenden Kontrakten verwendet werden, um einen reibungslosen Übergang vom EONIA auf den €STR zu gewährleisten. In diesem Zusammenhang [empfahl](#) die Arbeitsgruppe des privaten Sektors zu risikofreien Zinssätzen am 14. März 2019, dass der EONIA anhand eines festen Spreads zum €STR berechnet werden soll und nicht anhand von fortgesetzten Meldungen eines Panels von Banken. Dieser Empfehlung zufolge beziehen sich der EONIA wie auch der €STR dann auf Transaktionen, die am vorhergehenden

Geschäftstag getätigt wurden. Das [European Money Market Institute](#), in seiner Funktion als Administrator des EONIA, hat heute die neue EONIA-Methodik beschlossen, die ab dem 2. Oktober 2019 und bis zu ihrer Außerkraftsetzung durch das EMMI wirksam sein wird.

Der Zinsaufschlag zwischen EONIA und €STR wird wie folgt ermittelt:

1. Berechnung des täglichen Spreads zwischen EONIA und Pre-€STR für das letzte Jahr, für das Pre-€STR-Daten öffentlich verfügbar sind (17. April 2018 bis 16. April 2019)
2. Sortierung der Spread-Reihe vom niedrigsten zum höchsten Spread
3. Streichung der obersten und untersten 15 % der Werte der sortierten Datenreihe (ggf. mit partiell gewichteter Einbeziehung der Randwerte)
4. Berechnung des arithmetischen Mittels der verbleibenden 70 % der Angaben.

**Europäische Zentralbank**

Generaldirektion Kommunikation

Sonnemannstraße 20, 60314 Frankfurt am Main, Deutschland

Tel.: +49 69 1344 7455, E-Mail: [media@ecb.europa.eu](mailto:media@ecb.europa.eu)

Internet: [www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu)

*Nachdruck nur mit Quellenangabe gestattet.*