

EURIBOR-, LIBOR- und Taggeld-Sätze

Der EURIBOR (European Interbank Offered Rate) ist ein für Termingelder in Euro ermittelter Zinssatz im Handel zwischen Geschäftsbanken bester Bonität. Die Festlegung erfolgt um 11 Uhr Brüsseler Zeit (EURIBOR) jeweils für Laufzeiten bis zu 12 Monaten.

Der LIBOR hingegen ist ein für Termingelder in den wichtigsten Fremdwährungen ermittelter Zinssatz im Handel zwischen Geschäftsbanken bester Bonität. Die Veröffentlichung des LIBOR in CHF wurde per 31.12.2021 eingestellt.

In den Währungen JPY und GBP wurde die klassische Berechnung des LIBOR ebenfalls per 31.12.2021 eingestellt. Die LIBOR Sätze in JPY und GBP wurden auf synthetischer Basis bis 31.12.2022 weiterhin veröffentlicht und danach ebenfalls eingestellt. Per 30.06.2023 wurde nun auch die Veröffentlichung des USD-Libors eingestellt.

Als Nachfolger für den CHF-LIBOR wurde der SARON (Compound) bestimmt. Der SARON ist ein von der Börsenbetreiberin SIX (Swiss Exchange) berechneter und publizierter Referenzzinssatz, der täglich aufgrund von tatsächlichen Transaktionen am Schweizer Repomarkt ermittelt wird.

Währung	Taggeld
EUR (€STR)	3,911
CHF (SARON)	1,450
JPY (TONA)	0,077
USD (SOFR)	5,310

Währung	1 Monat	3 Monate	6 Monate	12 Monate
EUR (EURIBOR)	3,828	3,895	3,842	3,72
CHF (SARON) ¹	1,451	1,633	1,704	1,834

¹SARON Compound inkl. laufzeitkonformen Adjustment-Spread (=gesetzlicher Nachfolger des CHF-LIBOR)

Stand: 17.04.2024 Alle Angaben ohne Gewähr.