

A31 Währungsreserven der Schweiz Switzerland's reserve assets

In Millionen Franken beziehungsweise Dollar / In CHF millions or US dollars

Bestände Ende November 2011

Level at the end of November 2011

CHF	in USD	in CHF			
		Restlaufzeit Residual maturity			
		Bis 1 Monat Up to 1 month	Über 1 Monat bis 3 Monate Over 1 month and below 3 months	Über 3 Monate bis 1 Jahr Over 3 months and below 1 year	
	1	2	3	4	5

Offizielle Währungsreserven und übrige Aktiven in Fremdwährungen Official reserve assets and other foreign currency assets

	CHF	in USD	in CHF	in CHF	in CHF
I. Offizielle Währungsreserven und übrige Aktiven in Fremdwährungen (zu approximativem Marktwert) Official reserve assets and other foreign currency assets (approximate market value)	300 027	329 772	.	.	.
A Offizielle Währungsreserven Official reserve assets	292 149	321 113	.	.	.
1 Fremdwährungsreserven (in konvertierbaren Fremdwährungen) Foreign currency reserves (in convertible foreign currencies)	231 581	254 541	.	.	.
a Wertschriften Securities	219 972	241 780	.	.	.
davon von im Ausland niedergelassenen Emittenten mit Hauptsitz in der Schweiz of which, borrower headquartered in Switzerland but located abroad	46	50	.	.	.
b Total Guthaben bei: Total currency and deposits with:	11 609	12 760	.	.	.
i anderen nationalen Zentralbanken, EZB, BIZ und IWF Other national central banks, ECB, BIS and IMF	11 179	12 287	.	.	.
ii Banken mit Hauptsitz in der Schweiz banks headquartered in Switzerland	319	351	.	.	.
davon bei Niederlassungen im Ausland of which, located abroad	—	—	.	.	.
iii Banken mit Hauptsitz im Ausland banks headquartered outside Switzerland	111	122	.	.	.
davon bei Niederlassungen in der Schweiz of which, located in Switzerland	62	68	.	.	.
2 Reserveposition beim IWF IMF reserve position	2 875	3 160	.	.	.
3 Sonderziehungsrechte (SZR) Special drawing rights (SDRs)	4 570	5 023	.	.	.
4 Gold (inklusive Goldeinlagen und Goldswaps) ¹ Gold (including gold deposits and gold swaps) ¹	53 123	58 390	.	.	.
5 Übrige Reservepositionen Other reserve assets	0	0	.	.	.
Derivative Finanzinstrumente Financial derivatives	0	0	.	.	.
Darlehen an Nichtbanken und Nichtschweizer Loans to nonbanks and nonresidents	—	—	.	.	.
Übrige Other	—	—	.	.	.
B Übrige Aktiven in Fremdwährungen (kein Bestandteil der offiziellen Währungsreserven) Other foreign currency assets (not included in official reserve assets)	7 878	8 659	.	.	.
Wertschriften Securities	—	—	.	.	.
Guthaben Deposits	225	247	.	.	.
Darlehen Loans	7 880	8 661	.	.	.
Derivative Finanzinstrumente Financial derivatives	- 227	- 250	.	.	.
Gold Gold	—	—	.	.	.
Übrige Other	—	—	.	.	.

CHF	in USD	in CHF			
		Restlaufzeit Residual maturity			
		Bis 1 Monat Up to 1 month	Über 1 Monat bis 3 Monate Over 1 month and below 3 months	Über 3 Monate bis 1 Jahr Over 3 months and below 1 year	
	1	2	3	4	5

Vorbestimmte kurzfristige Nettoabflüsse von Fremdwährungsbeständen Predetermined short-term net drains on foreign currency assets

II. Vorbestimmte kurzfristige Nettoabflüsse von Fremdwährungsbeständen (Nominalwert) Predetermined short-term net drains on foreign currency assets (nominal value)	- 1 491	- 1 639	- 1 572	- 783	865
1 Darlehen, Wertschriften und Guthaben in fremder Währung (inklusive Zinsen) Foreign currency loans, securities and deposits (including interest)	—	—	—	—	—
Abflüsse (-) Outflows (-)	—	—	—	—	—
Kapitalbetrag ² Principal ²	—	—	—	—	—
Zinsbetrag Interest	—	—	—	—	—
Zuflüsse (+) Inflows (+)	—	—	—	—	—
Kapitalbetrag ² Principal ²	—	—	—	—	—
Zinsbetrag Interest	—	—	—	—	—
2 Total kurz- und langfristige Positionen in Forwards und Futures in fremder Währung gegenüber Schweizer Franken (inkl. Terminseite von Devisenswaps) Aggregate short and long positions in forwards and futures in foreign currencies vis-à-vis the domestic currency (including the forward leg of currency swaps)	- 29 382	- 32 295	- 28 034	- 2 213	865
a Short-Positionen Short positions	- 35 354	- 38 859	- 32 275	- 3 079	—
b Long-Positionen Long positions	5 972	6 564	4 241	866	865
3 Übrige Other	27 891	30 657	26 462	1 430	—
Abflüsse aus Repogeschäften (-) Outflows related to repos (-)	- 3 102	- 3 410	- 3 102	—	—
Zuflüsse aus Reverse Repogeschäften (+) Inflows related to reverse repos (+)	30 994	34 066	29 564	1 430	—
Handelskredit (-) Trade credit (-)	—	—	—	—	—
Handelskredit (+) Trade credit (+)	—	—	—	—	—
Übrige Verpflichtungen (-) Other accounts payable (-)	—	—	—	—	—
Übrige Guthaben (+) Other accounts receivable (+)	—	—	—	—	—

Bedingte kurzfristige Nettoabflüsse von Fremdwährungsbeständen Contingent short-term net drains on foreign currency assets

III. Bedingte kurzfristige Nettoabflüsse von Fremdwährungsbeständen (Nominalwert) Contingent short-term net drains on foreign currency assets (nominal value)	- 92	- 101	- 92	—	—
1 Eventualverpflichtungen in fremder Währung Contingent liabilities in foreign currency	- 92	- 101	- 92	—	—
a Gesicherte Verpflichtungen fällig innerhalb eines Jahres Collateral guarantees on debt falling due within 1 year	—	—	—	—	—
b Übrige Eventualverpflichtungen ³ Other contingent liabilities ³	- 92	- 101	- 92	—	—
2 Wertschriften in Fremdwährung mit Optionscharakter (Puttable Bonds) Foreign currency securities issued with embedded options (puttable bonds)	—	—	—	—	—

¹ Gewicht in tausend Feinunzen: 33 439.
Weight of gold in thousand fine ounces: 33 439.

² Inklusive Zinsbetrag.
Including interest.

³ Nachschusspflicht auf Namensaktien der BIZ.
Additional funding obligation for registered shares in BIS.

	CHF				
	1	in USD 2	in CHF Restlaufzeit Residual maturity		
			Bis 1 Monat Up to 1 month 3	Über 1 Monat bis 3 Monate Over 1 month and below 3 months 4	Über 3 Monate bis 1 Jahr Over 3 months and below 1 year 5
3 Nicht beanspruchte, unbedingte Kreditlimiten gewährt von: Undrawn, unconditional credit lines provided by:					
a anderen nationalen Währungsbehörden, EZB, BIZ, IWF und anderen internationalen Organisationen ⁴ Other national monetary authorities, ECB, BIS, IMF and other international organisations ⁴					
– anderen nationalen Währungsbehörden (+) Other national monetary authorities (+)					
– BIZ (+) BIS (+)					
– IWF (+) IMF (+)					
– Andere internationale Organisationen (+) Other international organizations (+)					
b Banken und anderen Finanzinstituten mit Hauptsitz in der Schweiz (+) Banks and other financial institutions headquartered in Switzerland (+)					
c Banken und anderen Finanzinstituten mit Hauptsitz im Ausland (+) Banks and other financial institutions headquartered outside Switzerland (+)					
4 Nicht beanspruchte, unbedingte Kreditlimiten gewährt an: Undrawn, unconditional credit lines provided to:					
a andere nationale Währungsbehörden, BIZ, IWF und andere internationale Organisationen ⁴ Other national monetary authorities, BIS, IMF and other international organisations ⁴					
– andere nationale Währungsbehörden (–) Other national monetary authorities (–)					
– BIZ (–) BIS (–)					
– IWF (–) IMF (–)					
– Andere internationale Organisationen (–) Other international organizations (–)					
b Banken und anderen Finanzinstituten mit Hauptsitz in der Schweiz (–) Banks and other financial institutions headquartered in Switzerland (–)					
c Banken und anderen Finanzinstituten mit Hauptsitz im Ausland (–) Banks and other financial institutions headquartered outside Switzerland (–)					
5 Total Short- und Long-Positionen von Optionen in fremder Währung gegenüber Schweizer Franken Aggregate short and long positions of options in foreign currencies vis-à-vis CHF	–	–	–	–	–
a Short-Positionen Short positions	–	–	–	–	–
i Gekaufte Puts Bought puts	–	–	–	–	–
ii Geschriebene Calls Written calls	–	–	–	–	–
b Long-Positionen Long positions	–	–	–	–	–
i Gekaufte Calls Bought calls	–	–	–	–	–
ii Geschriebene Puts Written puts	–	–	–	–	–
Pro Memoria: In-the-money-Optionen In-the-money options (memo items)					
1 Zu aktuellen Wechselkursen At current exchange rates					
a Short-Position Short position	–	–	–	–	–
b Long-Position Long position	–	–	–	–	–
2 + 5% (Wertabnahme von 5%) + 5% (depreciation of 5%)					
a Short-Position Short position	–	–	–	–	–
b Long-Position Long position	–	–	–	–	–

	CHF		in CHF		
	1	2	Restlaufzeit Residual maturity		
			Bis 1 Monat Up to 1 month	Über 1 Monat bis 3 Monate Over 1 month and below 3 months	Über 3 Monate bis 1 Jahr Over 3 months and below 1 year
3 – 5% (Wertzunahme von 5%) – 5% (appreciation of 5%)					
a Short-Position Short position	–	–	–	–	–
b Long-Position Long position	–	–	–	–	–
4 + 10% (Wertabnahme von 10%) + 10% (depreciation of 10%)					
a Short-Position Short position	–	–	–	–	–
b Long-Position Long position	–	–	–	–	–
5 – 10% (Wertzunahme von 10%) – 10% (appreciation of 10%)					
a Short-Position Short position	–	–	–	–	–
b Long-Position Long position	–	–	–	–	–
6 Übrige Other					
a Short-Position Short position	–	–	–	–	–
b Long-Position Long position	–	–	–	–	–

Pro Memoria / Memo items

IV. Pro Memoria Memo items					
1 a Kurzfristige, wechsellkursindexierte Verpflichtungen in Schweizer Franken Short-term debt in CHF indexed to the exchange rate	–	–	.	.	.
b Auf Fremdwährung lautende Finanzinstrumente mit anderer Rückzahlung (z. B. in Schweizer Franken) Financial instruments denominated in foreign currency and settled by other means (e.g. in CHF)	–	–	.	.	.
– Derivative Instrumente (Futures und Optionskontrakte) Derivatives (futures or options contracts)	–	–	.	.	.
– Short-Position Short position	–	–	.	.	.
– Long-Position Long position	–	–	.	.	.
– Übrige Instrumente Other instruments	–	–	.	.	.
c Verpfändete Wertschriften Pledged securities	– 332	– 365	.	.	.
– Bestandteil der Offiziellen Währungsreserven Included in official reserve assets	– 332	– 365	.	.	.
– Bestandteil der Übrigen Aktiven in Fremdwährung Included in other foreign currency assets	–	–	.	.	.
d Ausgeliehene und für Repogeschäfte eingesetzte Wertschriften: Securities lent and on repo:	43 022	47 287	.	.	.
– ausgeliehene oder für Repogeschäfte eingesetzte Wertschriften, enthalten in Teil I Lent or repoed and included in Section I	– 4 590	– 5 046	.	.	.
– ausgeliehene oder für Repogeschäfte eingesetzte Wertschriften nicht enthalten in Teil I Lent or repoed and not included in Section I	–	–	.	.	.
– geliehene oder erworbene Wertschriften, enthalten in Teil I Borrowed or acquired and included in Section I	–	–	.	.	.
– geliehene oder erworbenen Wertschriften, nicht enthalten in Teil I Borrowed or acquired but not included in Section I	47 612	52 333	.	.	.

⁴ Bilaterale Abkommen zum Zweck der gegenseitigen Währungshilfe in ausserordentlichen Lagen.
Bilateral agreements for the purpose of reciprocal balance of payments aid in extraordinary circumstances.

	CHF		Restlaufzeit Residual maturity		
	1	in USD 2	in CHF		
			Bis 1 Monat Up to 1 month 3	Über 1 Monat bis 3 Monate Over 1 month and below 3 months 4	Über 3 Monate bis 1 Jahr Over 3 months and below 1 year 5
e Derivative Finanzinstrumente (netto, markt bewertet) Financial derivative assets (net, marked to market)	- 228	- 250	.	.	.
- Forwards					
Forwards	- 227	- 249	.	.	.
- Futures					
Futures	1	1	.	.	.
- Swaps					
Swaps	—	—	.	.	.
- Optionen					
Options	- 1	- 1	.	.	.
- Übrige					
Other	—	—	.	.	.
f Derivate (Forwards, Futures oder Optionskontrakte), die Margin calls unterliegen und eine Restlaufzeit von mehr als einem Jahr aufweisen Derivatives (forwards, futures or options contracts) that are subject to margin calls and have a residual maturity greater than one year	2 567	2 821	.	.	.
- Total kurz- und langfristige Positionen in Forwards und Futures in fremder Währung gegenüber Schweizer Franken (inkl. Terminseite von Devisenswaps) Aggregate short and long positions in forwards and futures in foreign currencies vis-à-vis the domestic currency (including the forward leg of currency swaps)	2 567	2 821	.	.	.
a Short-Position (-) Short position (-)	—	—	.	.	.
b Long-Position (+) Long position (+)	2 567	2 821	.	.	.
- Total Short- und Long-Positionen auf Optionen in fremder Währung gegenüber Schweizer Franken Aggregate short and long positions of options in foreign currencies vis-à-vis the domestic currency	—	—	.	.	.
a Short-Position Short position	—	—	.	.	.
i Gekaufte Puts Bought puts	—	—	.	.	.
ii Geschriebene Calls Written calls	—	—	.	.	.
b Long-Position Long position	—	—	.	.	.
i Gekaufte Calls Bought calls	—	—	.	.	.
ii Geschriebene Puts Written puts	—	—	.	.	.
2 Zusammensetzung der Fremdwährungsreserven (nach Währungsgruppen) Currency composition of reserves (by groups of currencies)	292 149	321 113	.	.	.
- Währungen aus dem SZR-Währungskorb ⁵ Currencies in SDR basket ⁵	273 340	300 440	.	.	.
- Übrige Währungen Other currencies	18 809	20 674	.	.	.

⁵ Der SZR-Währungskorb setzt sich aus den Währungen USD, EUR, JPY und GBP zusammen.
The SDR currency basket is composed of the following currencies: USD, EUR, JPY and GBP.

