

A31 Währungsreserven der Schweiz Réerves monétaires de la Suisse

In Millionen Franken beziehungsweise Dollar / En millions de francs et de dollars

Bestände Ende November 2011
Niveau à fin novembre 2011

CHF	in USD en USD	in CHF en CHF			
		Restlaufzeit Durée résiduelle			
		Bis 1 Monat	Über 1 Monat bis 3 Monate	Über 3 Monate bis 1 Jahr	
		Jusqu'à 1 mois	Plus de 1 mois à 3 mois	Plus de 3 mois à 1 an	
	1	2	3	4	5

Offizielle Währungsreserven und übrige Aktiven in Fremdwährungen Réerves monétaires officielles et autres actifs en monnaies étrangères

	CHF	in USD en USD	in CHF en CHF	in CHF en CHF	in CHF en CHF
I. Offizielle Währungsreserven und übrige Aktiven in Fremdwährungen (zu approximativem Marktwerten) Réerves monétaires officielles et autres actifs en monnaies étrangères (approximativement aux prix du marché)	300 027	329 772	.	.	.
A Offizielle Währungsreserven Réerves monétaires officielles	292 149	321 113	.	.	.
1 Fremdwährungsreserven (in konvertierbaren Fremdwährungen) Réerves de devises (en monnaies étrangères convertibles)	231 581	254 541	.	.	.
a Wertschriften Titres	219 972	241 780	.	.	.
davon von im Ausland niedergelassenen Emittenten mit Hauptsitz in der Schweiz dont d'émetteurs établis à l'étranger et ayant leur siège principal en Suisse	46	50	.	.	.
b Total Guthaben bei: Total des dépôts:	11 609	12 760	.	.	.
i anderen nationalen Zentralbanken, EZB, BIZ und IWF dans des banques centrales nationales, à la BCE, à la BRI et au FMI	11 179	12 287	.	.	.
ii Banken mit Hauptsitz in der Schweiz dans des banques ayant leur siège principal en Suisse	319	351	.	.	.
davon bei Niederlassungen im Ausland dont dans des succursales à l'étranger	—	—	.	.	.
iii Banken mit Hauptsitz im Ausland dans des banques ayant leur siège principal à l'étranger	111	122	.	.	.
davon bei Niederlassungen in der Schweiz dont dans des succursales en Suisse	62	68	.	.	.
2 Reserveposition beim IWF Position de réserve au FMI	2 875	3 160	.	.	.
3 Sonderziehungsrechte (SZR) Droits de tirage spéciaux (DTS)	4 570	5 023	.	.	.
4 Gold (inklusive Goldeinlagen und Goldswaps) ¹ Or (y compris les dépôts et les swaps) ¹	53 123	58 390	.	.	.
5 Übrige Reservepositionen Autres avoirs de réserve	0	0	.	.	.
Derivative Finanzinstrumente Instruments financiers dérivés	0	0	.	.	.
Darlehen an Nichtbanken und Nichtschweizer Prêts au secteur non bancaire à l'étranger	—	—	.	.	.
Übrige Autres	—	—	.	.	.
B Übrige Aktiven in Fremdwährungen (kein Bestandteil der offiziellen Währungsreserven) Autres actifs en monnaies étrangères (non inclus dans les réserves monétaires officielles)	7 878	8 659	.	.	.
Wertschriften Titres	—	—	.	.	.
Guthaben Avoirs	225	247	.	.	.
Darlehen Prêts	7 880	8 661	.	.	.
Derivative Finanzinstrumente Instruments financiers dérivés	- 227	- 250	.	.	.
Gold Or	—	—	.	.	.
Übrige Autres	—	—	.	.	.

CHF	in USD en USD	in CHF en CHF			
		Restlaufzeit Durée résiduelle			
		Bis 1 Monat Jusqu'à 1 mois	Über 1 Monat bis 3 Monate Plus de 1 mois à 3 mois	Über 3 Monate bis 1 Jahr Plus de 3 mois à 1 an	
	1	2	3	4	5

Vorbestimmte kurzfristige Nettoabflüsse von Fremdwährungsbeständen
Sorties nettes de devises prévues à court terme

II. Vorbestimmte kurzfristige Nettoabflüsse von Fremdwährungsbeständen (Nominalwert)					
Sorties nettes de devises prévues à court terme (valeur nominale)	- 1 491	- 1 639	- 1 572	- 783	865
1 Darlehen, Wertschriften und Guthaben in fremder Währung (inklusive Zinsen)					
Prêts, titres et avoirs en monnaies étrangères (y compris intérêts)	—	—	—	—	—
Abflüsse (-)					
Sorties (-)	—	—	—	—	—
Kapitalbetrag ²					
Capital ²	—	—	—	—	—
Zinsbetrag					
Intérêts	—	—	—	—	—
Zuflüsse (+)					
Entrées (+)	—	—	—	—	—
Kapitalbetrag ²					
Capital ²	—	—	—	—	—
Zinsbetrag					
Intérêts	—	—	—	—	—
2 Total kurz- und langfristige Positionen in Forwards und Futures in fremder Währung gegenüber Schweizer Franken (inkl. Terminseite von Devisenswaps)					
Total des positions courtes et longues résultant de forwards et de futures en monnaies étrangères contre francs suisses (y compris le volet à terme des swaps de change)	- 29 382	- 32 295	- 28 034	- 2 213	865
a Short-Positionen					
Positions courtes	- 35 354	- 38 859	- 32 275	- 3 079	—
b Long-Positionen					
Positions longues	5 972	6 564	4 241	866	865
3 Übrige					
Autres	27 891	30 657	26 462	1 430	—
Abflüsse aus Repogeschäften (-)					
Sorties découlant de mises en pension de titres (-)	- 3 102	- 3 410	- 3 102	—	—
Zuflüsse aus Reverse Repogeschäften (+)					
Entrées découlant de prises en pension de titres (+)	30 994	34 066	29 564	1 430	—
Handelskredit (-)					
Crédits de commerciaux (-)	—	—	—	—	—
Handelskredit (+)					
Crédits de commerciaux (+)	—	—	—	—	—
Übrige Verpflichtungen (-)					
Autres engagements (-)	—	—	—	—	—
Übrige Guthaben (+)					
Autres avoirs (+)	—	—	—	—	—

Bedingte kurzfristige Nettoabflüsse von Fremdwährungsbeständen
Sorties nettes conditionnelles, à court terme, d'avoirs en monnaies étrangères

III. Bedingte kurzfristige Nettoabflüsse von Fremdwährungsbeständen (Nominalwert)					
Sorties nettes conditionnelles, à court terme, d'avoirs en monnaies étrangères (valeur nominale)	- 92	- 101	- 92	—	—
1 Eventualverpflichtungen in fremder Währung					
Engagements conditionnels en monnaies étrangères	- 92	- 101	- 92	—	—
a Gesicherte Verpflichtungen fällig innerhalb eines Jahres					
Engagements garantis échus dans les douze mois	—	—	—	—	—
b Übrige Eventualverpflichtungen ³					
Autres engagements conditionnels ³	- 92	- 101	- 92	—	—
2 Wertschriften in Fremdwährung mit Optionscharakter (Puttable Bonds)					
Titres en monnaies étrangères incluant un caractère d'option («puttable bonds»)	—	—	—	—	—

¹ Gewicht in tausend Feinunzen: 33 439.
Poids en milliers d'onces de fin: 33 439.

² Inklusive Zinsbetrag.
Y compris les intérêts.

³ Nachschusspflicht auf Namensaktien der BIZ.
Engagement de versement sur actions nominatives de la BRI.

	CHF				
	1	in USD en USD	in CHF en CHF		
			Restlaufzeit Durée résiduelle		
		Bis 1 Monat Jusqu'à 1 mois	Über 1 Monat bis 3 Monate Plus de 1 mois à 3 mois	Über 3 Monate bis 1 Jahr Plus de 3 mois à 1 an	5
3 Nicht beanspruchte, unbedingte Kreditlimiten gewährt von: Parts non utilisées de lignes de crédit irrévocables, ouvertes par:					
a anderen nationalen Währungsbehörden, EZB, BIZ, IWF und anderen internationalen Organisationen ⁴ d'autres autorités monétaires nationales, la BCE, la BRI, le FMI et d'autres organisations internationales ⁴					
– anderen nationalen Währungsbehörden (+) autres autorités monétaires nationales (+)					
– BIZ (+) BRI (+)					
– IWF (+) FMI (+)					
– Andere internationale Organisationen (+) Autres organisations internationales (+)					
b Banken und anderen Finanzinstituten mit Hauptsitz in der Schweiz (+) des banques et d'autres établissements financiers ayant leur siège principal en Suisse (+)					
c Banken und anderen Finanzinstituten mit Hauptsitz im Ausland (+) des banques et d'autres établissements financiers ayant leur siège principal à l'étranger (+)					
4 Nicht beanspruchte, unbedingte Kreditlimiten gewährt an: Parts non utilisées de lignes de crédit irrévocables, ouvertes en faveur:					
a andere nationale Währungsbehörden, BIZ, IWF und andere internationale Organisationen ⁴ d'autres autorités monétaires nationales, de la BRI, du FMI et d'autres organisations internationales ⁴					
– andere nationale Währungsbehörden (-) autres autorités monétaires nationales (-)					
– BIZ (-) BRI (-)					
– IWF (-) FMI (-)					
– Andere internationale Organisationen (-) Autres organisations internationales (-)					
b Banken und anderen Finanzinstituten mit Hauptsitz in der Schweiz (-) de banques et d'autres établissements financiers ayant leur siège principal en Suisse (-)					
c Banken und anderen Finanzinstituten mit Hauptsitz im Ausland (-) de banques et d'autres établissements financiers ayant leur siège principal à l'étranger (-)					
5 Total Short- und Long-Positionen von Optionen in fremder Währung gegen Schweizer Franken Total des positions courtes et longues découlant d'options en monnaies étrangères contre francs suisses	—	—	—	—	—
a Short-Positionen Positions courtes	—	—	—	—	—
i Gekaufte Puts puts achetés	—	—	—	—	—
ii Geschriebene Calls calls vendus	—	—	—	—	—
b Long-Positionen Positions longues	—	—	—	—	—
i Gekaufte Calls calls achetés	—	—	—	—	—
ii Geschriebene Puts puts vendus	—	—	—	—	—
Pro Memoria: In-the-money-Optionen Pour mémoire: options dans la monnaie					
1 Zu aktuellen Wechselkursen aux cours de change du jour					
a Short-Position position courte	—	—	—	—	—
b Long-Position position longue	—	—	—	—	—
2 + 5% (Wertabnahme von 5%) + 5% (dépréciation de 5%)					
a Short-Position position courte	—	—	—	—	—
b Long-Position position longue	—	—	—	—	—

	CHF		Restlaufzeit Durée résiduelle		
	1	in USD en USD	in CHF en CHF		5
			Bis 1 Monat Jusqu'à 1 mois	Über 1 Monat bis 3 Monate Plus de 1 mois à 3 mois	
3 – 5% (Wertzunahme von 5%) – 5% (appréciation de 5%)					
a Short-Position position courte	–	–	–	–	–
b Long-Position position longue	–	–	–	–	–
4 + 10% (Wertabnahme von 10%) + 10% (dépréciation de 10%)					
a Short-Position position courte	–	–	–	–	–
b Long-Position position longue	–	–	–	–	–
5 – 10% (Wertzunahme von 10%) – 10% (appréciation de 10%)					
a Short-Position position courte	–	–	–	–	–
b Long-Position position longue	–	–	–	–	–
6 Übrige autres					
a Short-Position position courte	–	–	–	–	–
b Long-Position position longue	–	–	–	–	–

Pro Memoria / Pour mémoire

IV. Pro Memoria Pour mémoire					
1 a Kurzfristige, wechsellkursindexierte Verpflichtungen in Schweizer Franken Engagements à court terme libellés en francs suisses et indexés sur cours de change	–	–	.	.	.
b Auf Fremdwährung lautende Finanzinstrumente mit anderer Rückzahlung (z. B. in Schweizer Franken) Instruments financiers libellés en monnaies étrangères avec remboursement dans une autre monnaie (en francs suisses par exemple)	–	–	.	.	.
– Derivative Instrumente (Futures und Optionskontrakte) Instruments dérivés (futures et contrats d'options)	–	–	.	.	.
– Short-Position Position courte	–	–	.	.	.
– Long-Position Position longue	–	–	.	.	.
– Übrige Instrumente Autres instruments	–	–	.	.	.
c Verpfändete Wertschriften Titres mis en gage	– 332	– 365	.	.	.
– Bestandteil der Offiziellen Währungsreserven entrant dans les réserves monétaires officielles	– 332	– 365	.	.	.
– Bestandteil der Übrigen Aktiven in Fremdwährung entrant dans les autres actifs en monnaies étrangères	–	–	.	.	.
d Ausgeliehene und für Repogeschäfte eingesetzte Wertschriften: Titres prêtés et mis en pension:	43 022	47 287	.	.	.
– ausgeliehene oder für Repogeschäfte eingesetzte Wertschriften, enthalten in Teil I titres prêtés ou mis en pension et entrant dans la section I	– 4 590	– 5 046	.	.	.
– ausgeliehene oder für Repogeschäfte eingesetzte Wertschriften nicht enthalten in Teil I titres prêtés ou mis en pension et n'entrant pas dans la section I	–	–	.	.	.
– geliehene oder erworbene Wertschriften, enthalten in Teil I titres prêtés ou acquis et entrant dans la section I	–	–	.	.	.
– geliehene oder erworbene Wertschriften, nicht enthalten in Teil I titres prêtés ou acquis et n'entrant pas dans la section I	47 612	52 333	.	.	.

⁴ Bilaterale Abkommen zum Zweck der gegenseitigen Währungshilfe in ausserordentlichen Lagen.
Accords bilatéraux portant sur des aides monétaires mutuelles dans des situations exceptionnelles.

	CHF				
	1	in USD en USD	in CHF en CHF	Restlaufzeit Durée résiduelle	
				Bis 1 Monat Jusqu'à 1 mois	Über 1 Monat bis 3 Monate Plus de 1 mois à 3 mois
e Derivative Finanzinstrumente (netto, marktbewertet) Instruments financiers dérivés (nets, à leur valeur de marché)	- 228	- 250	.	.	.
- Forwards forwards	- 227	- 249	.	.	.
- Futures futures	1	1	.	.	.
- Swaps swaps	—	—	.	.	.
- Optionen options	- 1	- 1	.	.	.
- Übrige autres	—	—	.	.	.
f Derivate (Forwards, Futures oder Optionskontrakte), die Margin calls unterliegen und eine Restlaufzeit von mehr als einem Jahr aufweisen Produits dérivés (forwards, futures et contrats d'options) ayant une durée résiduelle supérieure à un an et soumis à un appel de marge	2 567	2 821	.	.	.
- Total kurz- und langfristige Positionen in Forwards und Futures in fremder Währung gegenüber Schweizer Franken (inkl. Terminseite von Devisenswaps) Total des positions courtes et longues résultant de forwards et de futures en monnaies étrangères contre francs suisses (y compris le volet à terme des swaps de change)	2 567	2 821	.	.	.
a Short-Position (-) Position courte (-)	—	—	.	.	.
b Long-Position (+) Position longue (+)	2 567	2 821	.	.	.
- Total Short- und Long-Positionen auf Optionen in fremder Währung gegenüber Schweizer Franken Total des positions courtes et longues résultant d'options en monnaies étrangères contre francs suisses	—	—	.	.	.
a Short-Position Position courte	—	—	.	.	.
i Gekaufte Puts puts achetés	—	—	.	.	.
ii Geschriebene Calls calls vendus	—	—	.	.	.
b Long-Position Position longue	—	—	.	.	.
i Gekaufte Calls calls achetés	—	—	.	.	.
ii Geschriebene Puts puts vendus	—	—	.	.	.
2 Zusammensetzung der Fremdwährungsreserven (nach Währungsgruppen) Répartition des réserves de devises (groupes de monnaies)	292 149	321 113	.	.	.
- Währungen aus dem SZR-Währungskorb ⁵ monnaies entrant dans le panier de calcul du DTS ⁵	273 340	300 440	.	.	.
- Übrige Währungen autres monnaies	18 809	20 674	.	.	.

⁵ Der SZR-Währungskorb setzt sich aus den Währungen USD, EUR, JPY und GBP zusammen.
Le dollar des Etats-Unis, l'euro, le yen japonais et la livre sterling entrent dans le panier de calcul du DTS.

