

Kommunikation

Postfach, CH-8022 Zürich
 Telefon +41 58 631 00 00
communications@snb.ch

Zürich, 5. Oktober 2015

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 2. Oktober 2015

Referenzzinssätze SNB

in Prozent

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor ¹	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazilität ²	Zinssatz auf Giroguthaben ³
28.09.15	- 1.25 - - 0.25	- 0.72700	0.50	- 0.75
29.09.15	- 1.25 - - 0.25	- 0.73300	0.50	- 0.75
30.09.15	- 1.25 - - 0.25	- 0.73300	0.50	- 0.75
01.10.15	- 1.25 - - 0.25	- 0.73300	0.50	- 0.75
02.10.15	- 1.25 - - 0.25	- 0.73100	0.50	- 0.75

¹ London Interbank Offered Rate, berechnet durch die ICE Benchmark Administration Ltd. (IBA).

² SARON (Swiss Average Rate Overnight), 12.00 Uhr Fixing + 50 Basispunkte. Der Sondersatz beträgt immer mindestens 50 Basispunkte.

³ Wird nur auf jenem Teil der Giroguthaben erhoben, der einen bestimmten Betrag (Freibetrag) überschreitet.

Swiss Average Rates ⁴

in Prozent

Datum	SARON 12.00 Uhr Fixing	SARON Handelsschluss	SAR1W Handelsschluss	SAR1M Handelsschluss	SAR3M Handelsschluss
28.09.15	- 0.724	- 0.722	- 0.727	- 0.764	.
29.09.15	- 0.727	- 0.720	- 0.727	- 0.748	- 0.749
30.09.15	- 0.723	- 0.720	- 0.733	- 0.764	.
01.10.15	- 0.730	- 0.723	- 0.723	- 0.766	.
02.10.15	- 0.720	- 0.722	.	- 0.755	.

⁴ Die Swiss Average Rates sind volumengewichtete Durchschnittssätze, die auf abgeschlossenen Transaktionen und Referenzpreisen des jeweiligen Handelstages basieren. Die Berechnung der Referenzpreise stützt sich auf verfügbare Quotes im Orderbuch der elektronischen Handelsplattform der SIX Repo AG. Die Swiss Average Rates werden durch die SIX Swiss Exchange berechnet.

Medienmitteilung

Durchschnitt der Franken-Sichtguthaben bei der SNB für die Woche zum 2. Oktober 2015

in Mio. Franken

Giroguthaben inländischer Banken	399 162
Übrige Guthaben auf Sicht in Franken	66 140
Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken	465 303

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode⁵

in Mio. Franken

Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben	Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben
21.08.15	395 100	25.09.15	404 559
28.08.15	395 828	02.10.15	401 653
04.09.15	395 494		
11.09.15	396 330		
18.09.15	397 703		
Schlusswert Periode	398 043		

⁵ Die Unterlegungsperiode dauert vom 20. eines Monats bis zum 19. des Folgemonats.

Mindestreserven: Erfüllung für die letzten 12 Unterlegungsperioden

in Mio. Franken

Periode	Erfordernis	Anrechenbare Aktiven ⁶	Noten und Münzen	Giroguthaben	Erfüllungsgrad in %	Zinssatz ⁷ in %
20.08.14 - 19.09.14	14 568	318 987	6 321	312 666	2 190	4.00
20.09.14 - 19.10.14	14 587	318 499	6 574	311 925	2 183	4.00
20.10.14 - 19.11.14	14 655	320 037	6 455	313 582	2 184	3.99
20.11.14 - 19.12.14	14 600	322 699	6 675	316 024	2 210	4.00
20.12.14 - 19.01.15	14 590	339 878	7 472	332 407	2 330	3.99
20.01.15 - 19.02.15	14 530	389 974	6 724	383 250	2 684	3.21
20.02.15 - 19.03.15	14 718	386 146	6 632	379 514	2 624	3.28
20.03.15 - 19.04.15	14 769	386 876	6 784	380 091	2 620	3.30
20.04.15 - 19.05.15	14 782	387 619	6 813	380 806	2 622	3.27
20.05.15 - 19.06.15	14 538	389 634	6 777	382 858	2 680	3.28
20.06.15 - 19.07.15	14 331	400 099	6 700	393 399	2 792	3.26
20.07.15 - 19.08.15	14 317	401 986	6 255	395 731	2 808	3.27

⁶ Summe aus Noten, Münzen und Giroguthaben.

⁷ Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.