

Kommunikation

Postfach, CH-8022 Zürich
 Telefon +41 44 631 31 11
 Telefax +41 44 631 39 10

Zürich, 10. Oktober 2011

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 7. Oktober 2011

Referenzzinssätze SNB (in Prozent)

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
03.10.11	0.00 - 0.25	0.02333	0.51
04.10.11	0.00 - 0.25	0.02500	0.51
05.10.11	0.00 - 0.25	0.02667	0.50
06.10.11	0.00 - 0.25	0.02667	0.50
07.10.11	0.00 - 0.25	0.03000	0.51

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

Swiss Average Rates* (in Prozent)

Datum	SARON 12.00 Uhr Fixing	SARON Handelsschluss	SAR1W Handelsschluss	SAR1M Handelsschluss	SAR3M Handelsschluss
03.10.11	0.006	0.007	0.022	0.031	0.050
04.10.11	0.015	- 0.066	0.024	0.020	.
05.10.11	- 0.008	- 0.004	- 0.122	0.010	- 0.142
06.10.11	- 0.005	- 0.006	- 0.050	0.014	- 0.125
07.10.11	0.006	0.009	0.023	0.018	.

* 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 Eurex. Die Swiss Average Rates werden durch die SIX Swiss Exchange berechnet.

Aufgrund technischer Probleme der SIX Swiss Exchange können die Werte zurzeit teilweise nicht nachgeführt werden.

Durchschnitt der Franken-Sichtguthaben bei der SNB für die Woche zum 7. Oktober 2011

(in Mio. Franken)

Giroguthaben inländischer Banken	198 408
Übrige Guthaben auf Sicht in Franken	37 145
Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken	235 553

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode*

(in Mio. Franken)

Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben	Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben
26.08.11	163 906	23.09.11	204 000
02.09.11	177 757	30.09.11	201 754
09.09.11	187 731	07.10.11	200 453
16.09.11	192 244		
Schlusswert Periode	193 248		

* 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*	Noten Münzen	Giro- guthaben	Erfüllungs- grad in %	Zinssatz** in %
20.08.10 - 19.09.10	9 998	35 624	5 560	30 064	356	4.08
20.09.10 - 19.10.10	9 740	36 092	5 550	30 542	371	4.05
20.10.10 - 19.11.10	9 760	31 339	5 493	25 846	321	4.05
20.11.10 - 19.12.10	9 799	28 585	5 829	22 756	292	4.07
20.12.10 - 19.01.11	9 806	35 291	6 184	29 107	360	4.05
20.01.11 - 19.02.11	9 750	33 412	5 773	27 639	343	4.03
20.02.11 - 19.03.11	9 713	30 295	5 590	24 705	312	4.03
20.03.11 - 19.04.11	9 797	29 647	5 636	24 011	303	4.03
20.04.11 - 19.05.11	9 897	30 063	5 702	24 361	304	4.03
20.05.11 - 19.06.11	10 009	31 441	5 717	25 723	314	4.03
20.06.11 - 19.07.11	10 045	33 116	5 626	27 490	330	4.03
20.07.11 - 19.08.11	10 088	61 779	5 611	56 168	612	4.02

* Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben.

** Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.