

Kommunikation

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

Zürich, 24. Oktober 2011

**Geldpolitisch wichtige Daten
 für die Woche zum 21. Oktober 2011**

Referenzzinssätze SNB
 (in Prozent)

| Datum | Zielband für Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor | Sondersatz Engpassfinanzierungsfazilität* |
|----------|----------------------------------|------------------|--|
| 17.10.11 | 0.00 - 0.25 | 0.04000 | 0.50 |
| 18.10.11 | 0.00 - 0.25 | 0.04167 | 0.50 |
| 19.10.11 | 0.00 - 0.25 | 0.04167 | 0.50 |
| 20.10.11 | 0.00 - 0.25 | 0.04167 | 0.50 |
| 21.10.11 | 0.00 - 0.25 | 0.04167 | 0.50 |

* 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 |
|----------|---------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 17.10.11 | - 0.006 | 0.002 | 0.017 | - 0.017 | - 0.015 |
| 18.10.11 | 0.003 | 0.000 | - 0.057 | - 0.023 | - 0.073 |
| 19.10.11 | - 0.011 | - 0.011 | 0.017 | - 0.029 | - 0.049 |
| 20.10.11 | 0.003 | 0.005 | - 0.025 | - 0.045 | - 0.078 |
| 21.10.11 | - 0.037 | - 0.032 | 0.014 | - 0.041 | - 0.063 |

* 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.

Durchschnitt der Franken-Sichtguthaben bei der SNB für die Woche zum 21. Oktober 2011

(in Mio. Franken)

| | |
|---|----------------|
| Giroguthaben inländischer Banken | 190 971 |
| Übrige Guthaben auf Sicht in Franken | 40 581 |
| Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken | 231 552 |

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode*

(in Mio. Franken)

| Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis | Giroguthaben | Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis | Giroguthaben |
|--|--------------|--|--------------|
| 23.09.11 | 204 000 | 21.10.11 | 197 775 |
| 30.09.11 | 201 754 | | |
| 07.10.11 | 200 453 | | |
| 14.10.11 | 199 081 | | |
| Schlusswert Periode | 197 276 | | |

* 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 % |
|---------------------|-------------|--------------------------|-----------------|-------------------|--------------------------|--------------------|
| 20.09.10 - 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 | 4.04 |
| 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 |
| 20.08.11 - 19.09.11 | 10 301 | 198 847 | 5 614 | 193 233 | 1 930 | 4.00 |

* Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben.

** Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.