

Kommunikation

Postfach, CH-8022 Zürich
 Telefon +41 44 631 31 11
 communications@snb.ch

Zürich, 3. Januar 2012

**Geldpolitisch wichtige Daten
 für die Woche zum 30. Dezember 2011**

Referenzzinssätze SNB
 (in Prozent)

| Datum | Zielband für Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor* | Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität** |
|----------|----------------------------------|-------------------|---|
| 26.12.11 | 0.00 - 0.25 | . | . |
| 27.12.11 | 0.00 - 0.25 | . | 0.53 |
| 28.12.11 | 0.00 - 0.25 | 0.05167 | 0.52 |
| 29.12.11 | 0.00 - 0.25 | 0.05167 | 0.52 |
| 30.12.11 | 0.00 - 0.25 | 0.05167 | 0.52 |

* London Interbank Offered Rate, berechnet durch die British Bankers' Association.

** 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 |
|----------|---------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 26.12.11 | . | . | . | . | . |
| 27.12.11 | 0.027 | 0.026 | 0.055 | 0.120 | . |
| 28.12.11 | 0.019 | 0.020 | 0.050 | . | 0.080 |
| 29.12.11 | 0.020 | 0.020 | 0.030 | 0.010 | . |
| 30.12.11 | 0.017 | 0.018 | - 0.053 | 0.060 | 0.080 |

* 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 30. Dezember 2011

(in Mio. Franken)

| | |
|---|----------------|
| Giroguthaben inländischer Banken | 179 670 |
| Übrige Guthaben auf Sicht in Franken | 41 234 |
| Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken | 220 904 |

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode*

(in Mio. Franken)

| Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis | Giroguthaben | Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis | Giroguthaben |
|--|--------------|--|--------------|
| 25.11.11 | 184 017 | 23.12.11 | 179 583 |
| 02.12.11 | 182 473 | 30.12.11 | 179 638 |
| 09.12.11 | 180 397 | | |
| 16.12.11 | 178 557 | | |
| Schlusswert Periode | 178 711 | | |

* 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 % |
|---------------------|-------------|--------------------------|-----------------|-------------------|--------------------------|--------------------|
| 20.11.10 - 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 |
| 20.09.11 - 19.10.11 | 10 615 | 203 039 | 5 825 | 197 215 | 1 913 | 4.00 |
| 20.10.11 - 19.11.11 | 11 278 | 195 683 | 5 857 | 189 826 | 1 735 | 4.00 |

* Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben.

** Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.