

Kommunikation

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

Zürich, 23. Januar 2012

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 20. Januar 2012

Referenzzinssätze SNB

(in Prozent)

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor*	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität**
16.01.12	0.00 - 0.25	0.06167	0.52
17.01.12	0.00 - 0.25	0.06167	0.50
18.01.12	0.00 - 0.25	0.06167	0.50
19.01.12	0.00 - 0.25	0.06167	0.50
20.01.12	0.00 - 0.25	0.06167	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
16.01.12	0.022	0.020	0.004	0.018	0.071
17.01.12	- 0.018	- 0.015	- 0.054	- 0.009	0.080
18.01.12	- 0.026	- 0.017	- 0.007	- 0.005	0.021
19.01.12	0.003	- 0.001	0.001	- 0.095	0.026
20.01.12	0.023	0.021	- 0.028	0.031	.

* 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 20. Januar 2012

(in Mio. Franken)

Giroguthaben inländischer Banken	170 583
Übrige Guthaben auf Sicht in Franken	45 733
Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken	216 316

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode*

(in Mio. Franken)

Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben	Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben
23.12.11	179 583	20.01.12	168 497
30.12.11	179 638		
06.01.12	179 884		
13.01.12	178 675		
Schlusswert Periode	177 176		

* 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 %
20.12.10 - 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
20.11.11 - 19.12.11	11 745	184 513	5 828	178 685	1 571	4.02

* Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben.

** Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.