

Kommunikation

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

Zürich, 5. März 2012

**Geldpolitisch wichtige Daten
 für die Woche zum 2. März 2012**

Referenzzinssätze SNB
 (in Prozent)

| Datum | Zielband für Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor* | Sondersatz Engpassfinanzierungsfazilität** |
|----------|----------------------------------|-------------------|---|
| 27.02.12 | 0.00 - 0.25 | 0.08583 | 0.50 |
| 28.02.12 | 0.00 - 0.25 | 0.08583 | 0.50 |
| 29.02.12 | 0.00 - 0.25 | 0.08667 | 0.50 |
| 01.03.12 | 0.00 - 0.25 | 0.08833 | 0.50 |
| 02.03.12 | 0.00 - 0.25 | 0.09000 | 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 |
|----------|---------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 27.02.12 | - 0.010 | - 0.006 | - 0.032 | 0.042 | 0.070 |
| 28.02.12 | - 0.008 | - 0.009 | - 0.058 | - 0.010 | - 0.010 |
| 29.02.12 | - 0.001 | - 0.001 | - 0.048 | 0.032 | . |
| 01.03.12 | 0.005 | 0.004 | - 0.038 | 0.010 | 0.070 |
| 02.03.12 | 0.020 | 0.017 | - 0.017 | 0.047 | . |

* 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 2. März 2012

(in Mio. Franken)

| | |
|---|----------------|
| Giroguthaben inländischer Banken | 164 841 |
| Übrige Guthaben auf Sicht in Franken | 54 911 |
| Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken | 219 752 |

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode*

(in Mio. Franken)

| Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis | Giroguthaben | Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis | Giroguthaben |
|--|--------------|--|--------------|
| 20.01.12 | 168 497 | 24.02.12 | 168 026 |
| 27.01.12 | 168 373 | 02.03.12 | 166 168 |
| 03.02.12 | 169 935 | | |
| 10.02.12 | 170 364 | | |
| 17.02.12 | 169 649 | | |
| Schlusswert Periode | 169 435 | | |

* 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 % |
|---------------------|-------------|--------------------------|-----------------|-------------------|--------------------------|--------------------|
| 20.01.11 - 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 |
| 20.12.11 - 19.01.12 | 11 755 | 183 299 | 6 181 | 177 118 | 1 559 | 4.01 |

* Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben.

** Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.