

Kommunikation

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

Zürich, 4. Juni 2012

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 1. Juni 2012

Referenzzinssätze SNB

(in Prozent)

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor*	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität**
28.05.12	0.00 - 0.25	0.11333	.
29.05.12	0.00 - 0.25	0.10833	0.52
30.05.12	0.00 - 0.25	0.10083	0.52
31.05.12	0.00 - 0.25	0.09750	0.52
01.06.12	0.00 - 0.25	0.09583	0.51

* 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
28.05.12
29.05.12	0.017	0.017	- 0.023	- 0.049	.
30.05.12	0.020	0.020	- 0.026	- 0.064	.
31.05.12	0.016	0.016	- 0.019	- 0.034	- 0.039
01.06.12	0.012	0.012	- 0.015	0.008	0.002

* 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 1. Juni 2012

(in Mio. Franken)

Giroguthaben inländischer Banken	185 408
Übrige Guthaben auf Sicht in Franken	66 919
Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken	252 326

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode*

(in Mio. Franken)

Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben	Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben
20.04.12	158 906	25.05.12	171 655
27.04.12	158 782	01.06.12	179 060
04.05.12	156 365		
11.05.12	154 627		
18.05.12	154 922		
Schlusswert Periode	155 110		

* 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 %
20.04.11 - 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
20.01.12 - 19.02.12	11 577	175 100	5 635	169 466	1 512	4.00
20.02.12 - 19.03.12	11 350	167 709	5 679	162 030	1 478	4.00
20.03.12 - 19.04.12	11 134	166 072	5 908	160 163	1 492	4.00

* Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben.

** Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.