

Kommunikation

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

Zürich, 17. September 2012

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 14. September 2012

Referenzzinssätze SNB

(in Prozent)

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor*	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität**
10.09.12	0.00 - 0.25	0.04600	0.50
11.09.12	0.00 - 0.25	0.04600	0.50
12.09.12	0.00 - 0.25	0.04600	0.50
13.09.12	0.00 - 0.25	0.04600	0.50
14.09.12	0.00 - 0.25	0.04600	0.50

* 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
10.09.12	- 0.054	- 0.069	- 0.055	- 0.110	- 0.168
11.09.12	- 0.059	- 0.058	- 0.056	- 0.119	- 0.170
12.09.12	- 0.046	- 0.046	- 0.057	- 0.108	- 0.170
13.09.12	- 0.073	- 0.054	- 0.047	- 0.089	- 0.160
14.09.12	- 0.066	- 0.058	- 0.048	- 0.100	- 0.163

* 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 14. September 2012

(in Mio. Franken)

Giroguthaben inländischer Banken	294 152
Übrige Guthaben auf Sicht in Franken	79 146
Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken	373 297

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode*

(in Mio. Franken)

Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben	Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben
20.07.12	266 535	24.08.12	286 830
27.07.12	270 374	31.08.12	288 072
03.08.12	273 606	07.09.12	289 193
10.08.12	274 857	14.09.12	290 528
17.08.12	276 239		
Schlusswert Periode	276 820		

* 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 %
20.07.11 - 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	183 298	6 181	177 117	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	11 136	166 092	5 909	160 183	1 492	4.00
20.04.12 - 19.05.12	11 188	160 916	5 820	155 096	1 438	4.00
20.05.12 - 19.06.12	11 265	201 659	5 809	195 851	1 790	4.01
20.06.12 - 19.07.12	11 707	252 036	5 837	246 199	2 153	4.00

* Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben.

** Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.