

Kommunikation

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

Zürich, 15. Oktober 2012

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 12. Oktober 2012

Referenzzinssätze SNB

(in Prozent)

| Datum | Zielband für Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor* | Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität** |
|----------|----------------------------------|-------------------|---|
| 08.10.12 | 0.00 - 0.25 | 0.04000 | 0.53 |
| 09.10.12 | 0.00 - 0.25 | 0.03800 | 0.50 |
| 10.10.12 | 0.00 - 0.25 | 0.03700 | 0.50 |
| 11.10.12 | 0.00 - 0.25 | 0.03700 | 0.50 |
| 12.10.12 | 0.00 - 0.25 | 0.03700 | 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 |
|----------|---------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 08.10.12 | 0.027 | 0.026 | - 0.040 | - 0.155 | . |
| 09.10.12 | - 0.024 | - 0.030 | - 0.046 | - 0.154 | . |
| 10.10.12 | - 0.021 | - 0.021 | - 0.039 | - 0.147 | - 0.039 |
| 11.10.12 | - 0.003 | - 0.012 | - 0.029 | - 0.117 | - 0.060 |
| 12.10.12 | - 0.020 | - 0.030 | - 0.057 | - 0.084 | 0.050 |

* 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 12. Oktober 2012

(in Mio. Franken)

| | |
|---|----------------|
| Giroguthaben inländischer Banken | 293 142 |
| Übrige Guthaben auf Sicht in Franken | 79 814 |
| Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken | 372 956 |

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode*

(in Mio. Franken)

| Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis | Giroguthaben | Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis | Giroguthaben |
|--|--------------|--|--------------|
| 24.08.12 | 286 830 | 21.09.12 | 292 252 |
| 31.08.12 | 288 072 | 28.09.12 | 291 469 |
| 07.09.12 | 289 193 | 05.10.12 | 291 282 |
| 14.09.12 | 290 528 | 12.10.12 | 291 848 |
| Schlusswert Periode | 290 818 | | |

* 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 % |
|---------------------|-------------|--------------------------|-----------------|-------------------|--------------------------|--------------------|
| 20.08.11 - 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 |
| 20.07.12 - 19.08.12 | 11 988 | 282 432 | 5 827 | 276 605 | 2 356 | 3.98 |

* Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben.

** Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.