

Kommunikation

Postfach, CH-8022 Zürich
 Telefon +41 58 631 00 00
communications@snb.ch

Zürich, 21. Dezember 2015

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 18. Dezember 2015

Referenzzinssätze SNB

in Prozent

| Datum | Zielband für Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor ¹ | Sondersatz Engpassfinanzierungsfazilität ² | Zinssatz auf Giroguthaben ³ |
|----------|-------------------------------|-------------------------------|---|--|
| 14.12.15 | - 1.25 - - 0.25 | - 0.77100 | 0.50 | - 0.75 |
| 15.12.15 | - 1.25 - - 0.25 | - 0.77300 | 0.50 | - 0.75 |
| 16.12.15 | - 1.25 - - 0.25 | - 0.77100 | 0.50 | - 0.75 |
| 17.12.15 | - 1.25 - - 0.25 | - 0.76900 | 0.50 | - 0.75 |
| 18.12.15 | - 1.25 - - 0.25 | - 0.76900 | 0.50 | - 0.75 |

¹ London Interbank Offered Rate, berechnet durch die ICE Benchmark Administration Ltd. (IBA).

² SARON (Swiss Average Rate Overnight), 12.00 Uhr Fixing + 50 Basispunkte. Der Sondersatz beträgt immer mindestens 50 Basispunkte.

³ Wird nur auf jenem Teil der Giroguthaben erhoben, der einen bestimmten Betrag (Freibetrag) überschreitet.

Swiss Average Rates ⁴

in Prozent

| Datum | SARON 12.00 Uhr Fixing | SARON Handelsschluss | SAR1W Handelsschluss | SAR1M Handelsschluss | SAR3M Handelsschluss |
|----------|------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| 14.12.15 | - 0.734 | - 0.733 | - 0.700 | - 0.761 | - 0.747 |
| 15.12.15 | - 0.734 | - 0.732 | - 0.716 | - 0.770 | . |
| 16.12.15 | - 0.733 | - 0.731 | - 0.714 | - 0.770 | . |
| 17.12.15 | - 0.730 | - 0.726 | - 0.720 | - 0.770 | . |
| 18.12.15 | - 0.722 | - 0.725 | . | . | . |

⁴ 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 SIX Repo AG. Die Swiss Average Rates werden durch die SIX Swiss Exchange berechnet.

Medienmitteilung

Durchschnitt der Franken-Sichtguthaben bei der SNB für die Woche zum 18. Dezember 2015

in Mio. Franken

| | |
|---|----------------|
| Giroguthaben inländischer Banken | 406 130 |
| Übrige Guthaben auf Sicht in Franken | 62 241 |
| Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken | 468 371 |

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode⁵

in Mio. Franken

| Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis | Giroguthaben | Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis | Giroguthaben |
|---|--------------|---|--------------|
| 23.10.15 | 403 192 | 20.11.15 | 403 616 |
| 30.10.15 | 401 959 | 27.11.15 | 401 878 |
| 06.11.15 | 402 204 | 04.12.15 | 399 647 |
| 13.11.15 | 402 118 | 11.12.15 | 400 204 |
| | | 18.12.15 | 401 635 |
| Schlusswert Periode | 402 200 | | |

⁵ 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 ⁶ | Noten und Münzen | Giroguthaben | Erfüllungsgrad in % | Zinssatz ⁷ in % |
|---------------------|-------------|-----------------------------------|------------------|--------------|---------------------|----------------------------|
| 20.10.14 - 19.11.14 | 14 655 | 320 037 | 6 455 | 313 582 | 2 184 | 3.99 |
| 20.11.14 - 19.12.14 | 14 600 | 322 699 | 6 675 | 316 024 | 2 210 | 4.00 |
| 20.12.14 - 19.01.15 | 14 590 | 339 878 | 7 472 | 332 407 | 2 330 | 3.99 |
| 20.01.15 - 19.02.15 | 14 530 | 389 974 | 6 724 | 383 250 | 2 684 | 3.21 |
| 20.02.15 - 19.03.15 | 14 718 | 386 146 | 6 632 | 379 514 | 2 624 | 3.28 |
| 20.03.15 - 19.04.15 | 14 769 | 386 876 | 6 784 | 380 091 | 2 620 | 3.30 |
| 20.04.15 - 19.05.15 | 14 782 | 387 619 | 6 813 | 380 806 | 2 622 | 3.27 |
| 20.05.15 - 19.06.15 | 14 538 | 389 634 | 6 777 | 382 858 | 2 680 | 3.28 |
| 20.06.15 - 19.07.15 | 14 331 | 400 099 | 6 700 | 393 399 | 2 792 | 3.26 |
| 20.07.15 - 19.08.15 | 14 317 | 401 986 | 6 255 | 395 731 | 2 808 | 3.27 |
| 20.08.15 - 19.09.15 | 14 293 | 403 560 | 6 251 | 397 310 | 2 823 | 3.27 |
| 20.09.15 - 19.10.15 | 14 383 | 406 433 | 6 435 | 399 999 | 2 826 | 3.28 |

⁶ Summe aus Noten, Münzen und Giroguthaben.

⁷ Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.