

Kommunikation

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

Zürich, 17. Oktober 2016

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 14. Oktober 2016

Referenzzinssätze SNB

in Prozent

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor ¹	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazilität ²	Zinssatz auf Giroguthaben ³
10.10.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.73320	0.50	- 0.75
11.10.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.73120	0.50	- 0.75
12.10.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.72720	0.50	- 0.75
13.10.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.72620	0.50	- 0.75
14.10.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.72820	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
10.10.16	- 0.744	- 0.741	- 0.720	- 0.805	.
11.10.16	- 0.742	- 0.741	- 0.759	- 0.805	.
12.10.16	- 0.749	- 0.743	- 0.749	- 0.810	.
13.10.16	- 0.750	- 0.744	- 0.720	- 0.798	.
14.10.16	- 0.743	- 0.743	.	- 0.793	.

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 14. Oktober 2016

in Mio. Franken

Giroguthaben inländischer Banken	451 376
Übrige Guthaben auf Sicht in Franken	66 801
Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken	518 176

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode⁵

in Mio. Franken

Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben	Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben
26.08.16	438 083	23.09.16	447 226
02.09.16	438 407	30.09.16	450 850
09.09.16	438 457	07.10.16	451 276
16.09.16	438 520	14.10.16	451 304
Schlusswert Periode	438 769		

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 %
20.08.15 - 19.09.15	14 297	403 566	6 251	397 315	2 823	3.27
20.09.15 - 19.10.15	14 387	406 433	6 435	399 999	2 825	3.28
20.10.15 - 19.11.15	14 401	407 943	6 612	401 331	2 833	3.27
20.11.15 - 19.12.15	14 403	407 851	6 589	401 262	2 832	3.27
20.12.15 - 19.01.16	14 445	410 271	7 010	403 261	2 840	3.27
20.01.16 - 19.02.16	14 532	414 238	6 450	407 788	2 851	3.27
20.02.16 - 19.03.16	14 682	422 316	6 710	415 606	2 876	3.27
20.03.16 - 19.04.16	14 798	428 956	7 146	421 809	2 899	3.29
20.04.16 - 19.05.16	14 926	427 781	7 270	420 511	2 866	3.27
20.05.16 - 19.06.16	14 976	424 001	7 341	416 660	2 831	3.27
20.06.16 - 19.07.16	15 053	437 486	6 758	430 728	2 906	3.25
20.07.16 - 19.08.16	15 184	441 326	6 683	434 643	2 906	3.26

⁶ Summe aus Noten, Münzen und Giroguthaben.

⁷ Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.