

Kommunikation

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

Zürich, 3. Januar 2017

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 30. Dezember 2016

Referenzzinssätze SNB

In Prozent

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor ¹	Sondersatz (Engpass- finanzierungsfazität) ²	Zinssatz auf Giroguthaben ³
26.12.16	-1.25 - -0.25	.	.	-0.75
27.12.16	-1.25 - -0.25	.	0.50	-0.75
28.12.16	-1.25 - -0.25	-0.73320	0.50	-0.75
29.12.16	-1.25 - -0.25	-0.72920	0.50	-0.75
30.12.16	-1.25 - -0.25	-0.72920	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 Rates⁴

In Prozent

Datum	SARON 12.00 Uhr Fixing	SARON Handelsschluss	SAR1W Handelsschluss	SAR1M Handelsschluss	SAR3M Handelsschluss
26.12.16
27.12.16	-0.743	-0.741	.	-0.826	.
28.12.16	-0.736	-0.735	-0.720	-0.837	-0.800
29.12.16	-0.739	-0.736	.	.	.
30.12.16	-0.729	-0.732	.	.	.

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 30. Dezember 2016

In Mio. Franken

Giroguthaben inländischer Banken	466'272
Übrige Guthaben auf Sicht in Franken	62'693
Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken	528'965

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode⁵

In Mio. Franken

Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben	Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben
25.11.16	463'018	23.12.16	465'682
02.12.16	460'104	30.12.16	466'057
09.12.16	458'259		
16.12.16	458'013		
Schlusswert Periode	458'301		

⁵ Die Unterlegungsperiode dauert vom 20. eines Monats bis zum 19. des Folgemonats.

Mindestreserven: Erfüllung für die letzten 12 Unterlegungsperioden

In Mio. Franken

Unterlegungsperiode	Erfordernis	Anrechenbare Aktiven ⁶	Schweizer Noten und Münzen	Giroguthaben bei der SNB	Erfüllungsgrad in Prozent	Zinssatz ⁷ in Prozent
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
20.08.16 - 19.09.16	15'266	444'472	6'537	437'936	2'912	3.26
20.09.16 - 19.10.16	15'419	456'829	6'383	450'446	2'963	3.26
20.10.16 - 19.11.16	15'519	458'411	6'266	452'145	2'954	3.26

⁶ Summe aus Schweizer Noten und Münzen sowie Giroguthaben bei der SNB.

⁷ Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.