

Kommunikation

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

Zürich, 18. September 2017

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 15. September 2017

Referenzzinssätze SNB

In Prozent

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor ¹	Sondersatz (Engpass- finanzierungsfazität) ²	Zinssatz auf Giroguthaben ³
11.09.17	-1.25 - -0.25	-0.72600	0.50	-0.75
12.09.17	-1.25 - -0.25	-0.72600	0.50	-0.75
13.09.17	-1.25 - -0.25	-0.72600	0.50	-0.75
14.09.17	-1.25 - -0.25	-0.72600	0.50	-0.75
15.09.17	-1.25 - -0.25	.	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
11.09.17	-0.744	-0.740	-0.720	-0.820	-0.820
12.09.17	-0.748	-0.743	-0.730	-0.809	-0.750
13.09.17	-0.746	-0.741	-0.720	-0.815	.
14.09.17	-0.749	-0.744	.	-0.818	.
15.09.17	-0.744	-0.739	.	-0.820	.

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 15. September 2017

In Mio. Franken

Giroguthaben inländischer Banken	472'550
Übrige Guthaben auf Sicht in Franken	106'481
Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken	579'032

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode⁵

In Mio. Franken

Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben	Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben
21.07.17	475'847	25.08.17	471'729
28.07.17	478'248	01.09.17	469'999
04.08.17	478'953	08.09.17	470'511
11.08.17	478'145	15.09.17	471'040
18.08.17	476'305		
Schlusswert Periode	476'219		

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
20.07.16 - 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	15'520	458'411	6'266	452'145	2'954	3.26
20.11.16 - 19.12.16	15'766	464'061	6'628	457'433	2'943	3.27
20.12.16 - 19.01.17	15'806	472'308	7'222	465'086	2'988	3.26
20.01.17 - 19.02.17	15'684	471'982	6'686	465'296	3'009	3.26
20.02.17 - 19.03.17	15'630	475'609	6'154	469'455	3'043	3.26
20.03.17 - 19.04.17	15'665	483'315	6'460	476'854	3'085	3.29
20.04.17 - 19.05.17	15'842	488'200	6'562	481'638	3'082	3.26
20.05.17 - 19.06.17	16'020	488'306	6'616	481'690	3'048	3.26
20.06.17 - 19.07.17	16'065	491'370	6'544	484'826	3'059	3.26

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

⁷ Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.