

Kommunikation

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

Zürich, 8. Oktober 2012

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 5. Oktober 2012

Referenzzinssätze SNB

(in Prozent)

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor*	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität**
01.10.12	0.00 - 0.25	0.04300	0.50
02.10.12	0.00 - 0.25	0.04200	0.50
03.10.12	0.00 - 0.25	0.04000	0.50
04.10.12	0.00 - 0.25	0.04000	0.50
05.10.12	0.00 - 0.25	0.04000	0.53

* 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
01.10.12	- 0.044	- 0.034	- 0.045	- 0.130	.
02.10.12	- 0.052	- 0.052	- 0.030	- 0.129	- 0.123
03.10.12	- 0.035	- 0.035	- 0.026	- 0.130	.
04.10.12	- 0.036	- 0.020	- 0.063	- 0.111	- 0.200
05.10.12	0.030	0.030	- 0.036	- 0.136	.

* 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 5. Oktober 2012

(in Mio. Franken)

Giroguthaben inländischer Banken	291 041
Übrige Guthaben auf Sicht in Franken	81 693
Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken	372 734

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		
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.