

Kommunikation

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

Zürich, 11. August 2014

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 8. August 2014

Referenzzinssätze SNB (in Prozent)

| Datum | Zielband für Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor ¹ | Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität ² |
|----------|----------------------------------|-------------------------------|--|
| 04.08.14 | 0.00 - 0.25 | 0.01800 | 0.50 |
| 05.08.14 | 0.00 - 0.25 | 0.02200 | 0.50 |
| 06.08.14 | 0.00 - 0.25 | 0.02000 | 0.50 |
| 07.08.14 | 0.00 - 0.25 | 0.02000 | 0.50 |
| 08.08.14 | 0.00 - 0.25 | 0.02000 | 0.50 |

¹ London Interbank Offered Rate, berechnet durch die British Bankers' Association.

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

Swiss Average Rates³ (in Prozent)

| Datum | SARON 12.00 Uhr Fixing | SARON Handelsschluss | SAR1W Handelsschluss | SAR1M Handelsschluss | SAR3M Handelsschluss |
|----------|---------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 04.08.14 | - 0.014 | - 0.027 | - 0.032 | - 0.063 | . |
| 05.08.14 | - 0.023 | - 0.021 | - 0.048 | - 0.060 | . |
| 06.08.14 | - 0.019 | - 0.019 | - 0.050 | - 0.051 | . |
| 07.08.14 | - 0.022 | - 0.023 | - 0.037 | - 0.073 | . |
| 08.08.14 | - 0.029 | - 0.029 | - 0.058 | - 0.073 | 0.030 |

³ 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 8. August 2014
 (in Mio. Franken)

| | |
|---|----------------|
| Giroguthaben inländischer Banken | 309 522 |
| Übrige Guthaben auf Sicht in Franken | 57 907 |
| Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken | 367 430 |

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode⁴
 (in Mio. Franken)

| Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis | Giroguthaben | Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis | Giroguthaben |
|--|--------------|--|--------------|
| 20.06.14 | 302 015 | 25.07.14 | 310 457 |
| 27.06.14 | 301 208 | 01.08.14 | 310 210 |
| 04.07.14 | 301 391 | 08.08.14 | 309 969 |
| 11.07.14 | 302 940 | | |
| 18.07.14 | 304 276 | | |
| Schlusswert Periode | 304 452 | | |

⁴ Die Unterlegungsperiode dauert vom 20. eines Monats bis zum 19. des Folgemonats.

Mindestreserven: Erfüllung für die letzten 12 Unterlegungsperioden⁵
 (in Mio. Franken)

| Periode | Erfordernis | Anrechenbare Noten Aktiven ⁶ | Noten Münzen | Giro- guthaben | Erfüllungs- grad in % | Zinssatz ⁷ in % |
|---------------------|-------------|--|-----------------|-------------------|--------------------------|-------------------------------|
| 20.06.13 - 19.07.13 | 15 172 | 329 058 | 7 460 | 321 598 | 2 169 | 3.99 |
| 20.07.13 - 19.08.13 | 14 919 | 328 252 | 7 364 | 320 888 | 2 200 | 3.98 |
| 20.08.13 - 19.09.13 | 14 747 | 325 983 | 7 024 | 318 959 | 2 210 | 3.99 |
| 20.09.13 - 19.10.13 | 14 651 | 326 618 | 6 997 | 319 621 | 2 229 | 3.99 |
| 20.10.13 - 19.11.13 | 14 640 | 324 740 | 6 573 | 318 167 | 2 218 | 3.98 |
| 20.11.13 - 19.12.13 | 14 673 | 324 498 | 6 802 | 317 696 | 2 212 | 3.98 |
| 20.12.13 - 19.01.14 | 14 677 | 327 081 | 7 750 | 319 331 | 2 229 | 3.99 |
| 20.01.14 - 19.02.14 | 14 789 | 324 008 | 6 650 | 317 357 | 2 191 | 3.98 |
| 20.02.14 - 19.03.14 | 14 818 | 321 200 | 6 452 | 314 748 | 2 168 | 3.98 |
| 20.03.14 - 19.04.14 | 14 822 | 321 696 | 6 492 | 315 204 | 2 170 | 3.98 |
| 20.04.14 - 19.05.14 | 14 765 | 315 194 | 6 588 | 308 606 | 2 135 | 3.99 |
| 20.05.14 - 19.06.14 | 14 824 | 308 992 | 6 603 | 302 388 | 2 084 | 3.98 |

⁵ Aufgrund der Erteilung der Bankenlizenz an die PostFinance AG am 26. Juni 2013 kommt es in der Unterlegungsperiode vom 20. Juni 2013 bis 19. Juli 2013 zu Reihenbrüchen.

⁶ Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben.

⁷ Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.