

Kommunikation

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

Zürich, 4. April 2016

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 1. April 2016

Referenzzinssätze SNB

in Prozent

| Datum | Zielband für Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor ¹ | Sondersatz Engpassfinanzierungsfazilität ² | Zinssatz auf Giroguthaben ³ |
|----------|-------------------------------|-------------------------------|---|--|
| 28.03.16 | - 1.25 - - 0.25 | . | . | - 0.75 |
| 29.03.16 | - 1.25 - - 0.25 | - 0.72920 | 0.50 | - 0.75 |
| 30.03.16 | - 1.25 - - 0.25 | - 0.72920 | 0.50 | - 0.75 |
| 31.03.16 | - 1.25 - - 0.25 | - 0.72920 | 0.50 | - 0.75 |
| 01.04.16 | - 1.25 - - 0.25 | - 0.73320 | 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 |
|----------|------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| 28.03.16 | . | . | . | . | . |
| 29.03.16 | - 0.732 | - 0.731 | - 0.717 | - 0.772 | . |
| 30.03.16 | - 0.737 | - 0.733 | - 0.750 | . | . |
| 31.03.16 | - 0.740 | - 0.738 | - 0.650 | . | . |
| 01.04.16 | - 0.742 | - 0.738 | . | - 0.770 | . |

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 1. April 2016

in Mio. Franken

| | |
|---|----------------|
| Giroguthaben inländischer Banken | 420 266 |
| Übrige Guthaben auf Sicht in Franken | 63 495 |
| Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken | 483 761 |

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode⁵

in Mio. Franken

| Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis | Giroguthaben | Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis | Giroguthaben |
|---|--------------|---|--------------|
| 26.02.16 | 418 085 | 25.03.16 | 419 340 |
| 04.03.16 | 416 679 | 01.04.16 | 419 839 |
| 11.03.16 | 415 081 | | |
| 18.03.16 | 415 915 | | |
| Schlusswert Periode | 416 096 | | |

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 % |
|---------------------|-------------|-----------------------------------|------------------|--------------|---------------------|----------------------------|
| 20.02.15 - 19.03.15 | 14 722 | 386 146 | 6 632 | 379 514 | 2 623 | 3.28 |
| 20.03.15 - 19.04.15 | 14 772 | 386 876 | 6 784 | 380 091 | 2 619 | 3.30 |
| 20.04.15 - 19.05.15 | 14 786 | 387 619 | 6 813 | 380 806 | 2 622 | 3.27 |
| 20.05.15 - 19.06.15 | 14 542 | 389 634 | 6 777 | 382 858 | 2 679 | 3.28 |
| 20.06.15 - 19.07.15 | 14 335 | 400 099 | 6 700 | 393 399 | 2 791 | 3.26 |
| 20.07.15 - 19.08.15 | 14 321 | 401 986 | 6 255 | 395 731 | 2 807 | 3.27 |
| 20.08.15 - 19.09.15 | 14 298 | 403 560 | 6 251 | 397 310 | 2 823 | 3.27 |
| 20.09.15 - 19.10.15 | 14 388 | 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 | 401 261 | 2 832 | 3.27 |
| 20.12.15 - 19.01.16 | 14 444 | 410 271 | 7 010 | 403 261 | 2 840 | 3.27 |
| 20.01.16 - 19.02.16 | 14 530 | 414 237 | 6 449 | 407 788 | 2 851 | 3.27 |

⁶ Summe aus Noten, Münzen und Giroguthaben.

⁷ Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.