

Kommunikation

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

Zürich, 28. November 2016

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 25. November 2016

Referenzzinssätze SNB

in Prozent

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor ¹	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazilität ²	Zinssatz auf Giroguthaben ³
21.11.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.74400	0.50	- 0.75
22.11.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.74540	0.50	- 0.75
23.11.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.74640	0.50	- 0.75
24.11.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.74640	0.50	- 0.75
25.11.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.74640	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
21.11.16	- 0.733	- 0.733	- 0.730	.	.
22.11.16	- 0.734	- 0.733	- 0.735	- 0.800	.
23.11.16	- 0.733	- 0.735	- 0.736	- 0.787	.
24.11.16	- 0.729	- 0.732	- 0.753	- 0.806	.
25.11.16	- 0.736	- 0.734	- 0.723	- 0.800	.

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 25. November 2016

in Mio. Franken

Giroguthaben inländischer Banken	463 012
Übrige Guthaben auf Sicht in Franken	64 606
Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken	527 619

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode⁵

in Mio. Franken

Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben	Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben
21.10.16	449 581	25.11.16	463 018
28.10.16	451 421		
04.11.16	451 605		
11.11.16	451 070		
18.11.16	452 781		
Schlusswert Periode	453 110		

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 %
20.10.15 - 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	401 262	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	15 398	456 829	6 383	450 446	2 967	3.26

⁶ Summe aus Noten, Münzen und Giroguthaben.

⁷ Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.