

Kommunikation

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

Zürich, 1. Oktober 2018

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 28. September 2018

Referenzzinssätze SNB

In Prozent

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor ¹	Sondersatz (Engpass- finanzierungsfazität) ²	Zinssatz auf Giroguthaben ³
24.09.18	-1.25 - -0.25	-0.73300	0.50	-0.75
25.09.18	-1.25 - -0.25	-0.73360	0.50	-0.75
26.09.18	-1.25 - -0.25	-0.73220	0.50	-0.75
27.09.18	-1.25 - -0.25	-0.73360	0.50	-0.75
28.09.18	-1.25 - -0.25	-0.73580	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
24.09.18	-0.741	-0.736	-0.732	-0.777	-0.778
25.09.18	-0.741	-0.745	-0.745	-0.789	-0.778
26.09.18	-0.751	-0.760	-0.730	-0.787	-0.778
27.09.18	-0.755	-0.754	-0.700	-0.783	-0.775
28.09.18	-0.752	-0.786	-0.733	-0.783	-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 28. September 2018

In Mio. Franken

Giroguthaben inländischer Banken	474'784
Übrige Guthaben auf Sicht in Franken	103'129
Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken	577'914

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode⁵

In Mio. Franken

Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben	Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben
24.08.18	477'594	21.09.18	469'921
31.08.18	477'736	28.09.18	473'704
07.09.18	476'987		
14.09.18	476'374		
Schlusswert Periode	475'525		

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
20.08.17 - 19.09.17	16'068	477'128	6'327	470'801	2'970	3.26
20.09.17 - 19.10.17	15'931	474'559	6'228	468'330	2'979	3.26
20.10.17 - 19.11.17	15'880	474'167	6'228	467'939	2'986	3.26
20.11.17 - 19.12.17	15'939	480'344	6'242	474'102	3'014	3.26
20.12.17 - 19.01.18	16'159	475'989	6'896	469'093	2'946	3.30
20.01.18 - 19.02.18	16'350	467'254	6'516	460'739	2'858	3.26
20.02.18 - 19.03.18	16'370	465'519	6'171	459'348	2'844	3.25
20.03.18 - 19.04.18	16'373	471'167	6'283	464'884	2'878	3.29
20.04.18 - 19.05.18	16'375	474'262	6'251	468'012	2'896	3.27
20.05.18 - 19.06.18	16'342	468'286	6'133	462'153	2'865	3.27
20.06.18 - 19.07.18	16'381	473'732	6'192	467'540	2'892	3.27
20.07.18 - 19.08.18	16'353	477'941	6'246	471'695	2'923	3.27

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

7 Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.