

Kommunikation

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

Zürich, 2. Oktober 2017

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 29. September 2017

Referenzzinssätze SNB

In Prozent

| Datum | Zielband für Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor ¹ | Sondersatz (Engpass- finanzierungsfazität) ² | Zinssatz auf Giroguthaben ³ |
|----------|----------------------------------|-------------------------------|--|---|
| 25.09.17 | -1.25 - -0.25 | -0.72600 | 0.50 | -0.75 |
| 26.09.17 | -1.25 - -0.25 | -0.72600 | 0.50 | -0.75 |
| 27.09.17 | -1.25 - -0.25 | -0.72600 | 0.50 | -0.75 |
| 28.09.17 | -1.25 - -0.25 | -0.72600 | 0.50 | -0.75 |
| 29.09.17 | -1.25 - -0.25 | -0.72600 | 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 |
|----------|---------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 25.09.17 | -0.736 | -0.739 | -0.720 | -0.810 | -0.820 |
| 26.09.17 | -0.742 | -0.739 | -0.740 | -0.810 | -1.100 |
| 27.09.17 | -0.736 | -0.737 | -0.754 | -0.810 | -0.750 |
| 28.09.17 | -0.741 | -0.736 | -0.730 | -0.700 | . |
| 29.09.17 | -0.733 | -0.743 | -0.730 | . | . |

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 29. September 2017

In Mio. Franken

| | |
|---|----------------|
| Giroguthaben inländischer Banken | 472'974 |
| Übrige Guthaben auf Sicht in Franken | 105'988 |
| Total Sichtguthaben bei der SNB in Franken | 578'962 |

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode⁵

In Mio. Franken

| Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis | Giroguthaben | Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis | Giroguthaben |
|---|--------------|---|--------------|
| 25.08.17 | 471'729 | 22.09.17 | 475'615 |
| 01.09.17 | 469'999 | 29.09.17 | 473'766 |
| 08.09.17 | 470'511 | | |
| 15.09.17 | 471'040 | | |
| Schlusswert Periode | 471'760 | | |

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 |
|---------------------|-------------|-----------------------------------|----------------------------|--------------------------|---------------------------|----------------------------------|
| 20.08.16 - 19.09.16 | 15'266 | 444'472 | 6'537 | 437'936 | 2'912 | 3.26 |
| 20.09.16 - 19.10.16 | 15'419 | 456'829 | 6'383 | 450'446 | 2'963 | 3.26 |
| 20.10.16 - 19.11.16 | 15'520 | 458'411 | 6'266 | 452'145 | 2'954 | 3.26 |
| 20.11.16 - 19.12.16 | 15'766 | 464'061 | 6'628 | 457'433 | 2'943 | 3.27 |
| 20.12.16 - 19.01.17 | 15'806 | 472'308 | 7'222 | 465'086 | 2'988 | 3.26 |
| 20.01.17 - 19.02.17 | 15'684 | 471'982 | 6'686 | 465'296 | 3'009 | 3.26 |
| 20.02.17 - 19.03.17 | 15'630 | 475'609 | 6'154 | 469'455 | 3'043 | 3.26 |
| 20.03.17 - 19.04.17 | 15'665 | 483'315 | 6'460 | 476'854 | 3'085 | 3.29 |
| 20.04.17 - 19.05.17 | 15'842 | 488'200 | 6'562 | 481'638 | 3'082 | 3.26 |
| 20.05.17 - 19.06.17 | 16'020 | 488'306 | 6'616 | 481'690 | 3'048 | 3.26 |
| 20.06.17 - 19.07.17 | 16'065 | 491'370 | 6'544 | 484'826 | 3'059 | 3.26 |
| 20.07.17 - 19.08.17 | 16'082 | 481'970 | 6'513 | 475'457 | 2'997 | 3.26 |

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

⁷ Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.