

A31 Währungsreserven der Schweiz Réserves monétaires de la Suisse

In Millionen Franken beziehungsweise Dollar / En millions de francs et de dollars

Bestände Ende Januar 2015

Niveau à fin janvier 2015

CHF	in USD en USD	in CHF en CHF	Restlaufzeit Durée résiduelle		
			Bis 1 Monat	Über 1 Monat bis 3 Monate	Über 3 Monate bis 1 Jahr
			Jusqu'à 1 mois	Plus de 1 mois à 3 mois	Plus de 3 mois à 1 an
1	2	3	4	5	

Offizielle Währungsreserven und übrige Aktiven in Fremdwährungen Réserves monétaires officielles et autres actifs en monnaies étrangères

I. Offizielle Währungsreserven und übrige Aktiven in Fremdwährungen (zu approximativen Marktwerten) Réserves monétaires officielles et autres actifs en monnaies étrangères (approximativement aux prix du marché)	543 945	585 895	.	.	.
A Offizielle Währungsreserven Réserves monétaires officielles	543 544	585 463	.	.	.
1 Fremdwährungsreserven (in konvertierbaren Fremdwährungen) Réserves de devises (en monnaies étrangères convertibles)	498 463	536 905	.	.	.
a Wertschriften Titres	437 687	471 442	.	.	.
davon von im Ausland niedergelassenen Emittenten mit Hauptsitz in der Schweiz dont d'émetteurs établis à l'étranger et ayant leur siège principal en Suisse	153	165	.	.	.
b Total Guthaben bei: Total des dépôts:	60 776	65 463	.	.	.
i anderen nationalen Zentralbanken, EZB, BIZ und IWF dans des banques centrales nationales, à la BCE, à la BRI et au FMI	60 515	65 183	.	.	.
ii Banken mit Hauptsitz in der Schweiz dans des banques ayant leur siège principal en Suisse	54	58	.	.	.
davon bei Niederlassungen im Ausland dont dans des succursales à l'étranger	—	—	.	.	.
iii Banken mit Hauptsitz im Ausland dans des banques ayant leur siège principal à l'étranger	206	222	.	.	.
davon bei Niederlassungen in der Schweiz dont dans des succursales en Suisse	77	83	.	.	.
2 Reserveposition beim IWF Position de réserve au FMI	1 899	2 046	.	.	.
3 Sonderziehungsrechte (SZR) Droits de tirage spéciaux (DTS)	4 018	4 328	.	.	.
4 Gold (inklusive Goldeinlagen und Goldswaps) ¹ Or (y compris les dépôts et les swaps) ¹	39 142	42 161	.	.	.
5 Übrige Reservepositionen Autres avoirs de réserve	22	23	.	.	.
Derivative Finanzinstrumente Instruments financiers dérivés	22	23	.	.	.
Darlehen an Nichtbanken und Nichtschweizer Prêts au secteur non bancaire à l'étranger	—	—	.	.	.
Übrige Autres	—	—	.	.	.
B Übrige Aktiven in Fremdwährungen (kein Bestandteil der offiziellen Währungsreserven) Autres actifs en monnaies étrangères (non inclus dans les réserves monétaires officielles)	401	432	.	.	.
Wertschriften Titres	—	—	.	.	.
Guthaben Avoirs	350	376	.	.	.
Darlehen Prêts	192	207	.	.	.
Derivative Finanzinstrumente Instruments financiers dérivés	– 141	– 152	.	.	.
Gold Or	—	—	.	.	.
Übrige Autres	—	—	.	.	.

	CHF				
		in USD en USD	in CHF en CHF		
			Restlaufzeit Durée résiduelle		
			Bis 1 Monat Jusqu'à 1 mois	Über 1 Monat bis 3 Monate Plus de 1 mois à 3 mois	Über 3 Monate bis 1 Jahr Plus de 3 mois à 1 an
	1	2	3	4	5

Vorbestimmte kurzfristige Nettoabflüsse von Fremdwährungsbeständen Sorties nettes de devises prévues à court terme

II. Vorbestimmte kurzfristige Nettoabflüsse von Fremdwährungsbeständen (Nominalwert) Sorties nettes de devises prévues à court terme (valeur nominale)					
	1201	1294	617	119	465
1 Darlehen, Wertschriften und Guthaben in fremder Währung (inklusive Zinsen) Prêts, titres et avoirs en monnaies étrangères (y compris intérêts)	—	—	—	—	—
Abflüsse (–) Sorties (–)	—	—	—	—	—
Kapitalbetrag ² Capital ²	—	—	—	—	—
Zinsbetrag Intérêts	—	—	—	—	—
Zuflüsse (+) Entrées (+)	—	—	—	—	—
Kapitalbetrag ² Capital ²	—	—	—	—	—
Zinsbetrag Intérêts	—	—	—	—	—
2 Total kurz- und langfristige Positionen in Forwards und Futures in fremder Währung gegenüber Schweizer Franken (inkl. Terminseite von Devisenswaps) Total des positions courtes et longues résultant de forwards et de futures en monnaies étrangères contre francs suisses (y compris le volet à terme des swaps de change)	736	793	152	119	465
a Short-Positionen Positions courtes	– 869	– 936	– 484	– 97	– 288
b Long-Positionen Positions longues	1 604	1 728	636	216	753
3 Übrige Autres	465	501	465	—	—
Abflüsse aus Repogeschäften (–) Sorties découlant de mises en pension de titres (–)	– 8 928	– 9 617	– 8 928	—	—
Zuflüsse aus Reverse Repogeschäften (+) Entrées découlant de prises en pension de titres (+)	9 393	10 118	9 393	—	—
Handelskredit (–) Crédits de commerciaux (–)	—	—	—	—	—
Handelskredit (+) Crédits de commerciaux (+)	—	—	—	—	—
Übrige Verpflichtungen (–) Autres engagements (–)	—	—	—	—	—
Übrige Guthaben (+) Autres avoirs (+)	—	—	—	—	—

Bedingte kurzfristige Nettoabflüsse von Fremdwährungsbeständen Sorties nettes conditionnelles, à court terme, d'avoirs en monnaies étrangères

III. Bedingte kurzfristige Nettoabflüsse von Fremdwährungsbeständen (Nominalwert) Sorties nettes conditionnelles, à court terme, d'avoirs en monnaies étrangères (valeur nominale)					
	– 85	– 91	– 85	—	—
1 Eventualverpflichtungen in fremder Währung Engagements conditionnels en monnaies étrangères	– 85	– 91	– 85	—	—
a Gesicherte Verpflichtungen fällig innerhalb eines Jahres Engagements garantis échus dans les douze mois	—	—	—	—	—
b Übrige Eventualverpflichtungen ³ Autres engagements conditionnels ³	– 85	– 91	– 85	—	—
2 Wertschriften in Fremdwährung mit Optionscharakter (Puttable Bonds) Titres en monnaies étrangères incluant un caractère d'option («puttable bonds»)	—	—	—	—	—

¹ Gewicht in tausend Feinunzen: 33 437.
Poids en milliers d'onces de fin: 33 437.

² Inklusive Zinsbetrag.
Y compris les intérêts.

³ Nachschusspflicht auf Namensaktien der BIZ.
Engagement de versement sur actions nominatives de la BRI.

	CHF	in USD en USD	in CHF en CHF	Restlaufzeit Durée résiduelle		
				Bis 1 Monat	Über 1 Monat bis 3 Monate	Über 3 Monate bis 1 Jahr
				Jusqu'à 1 mois	Plus de 1 mois à 3 mois	Plus de 3 mois à 1 an
	1	2	3	4	5	
3 Nicht beanspruchte, unbedingte Kreditlimiten gewährt von: Parts non utilisées de lignes de crédit irrévocables, ouvertes par:	.	.	.	.	.	.
a anderen nationalen Währungsbehörden, EZB, BIZ, IWF und anderen internationalen Organisationen ⁴ d'autres autorités monétaires nationales, la BCE, la BRI, le FMI et d'autres organisations internationales ⁴	.	.	.	.	.	.
– anderen nationalen Währungsbehörden (+) autres autorités monétaires nationales (+)	.	.	.	.	.	.
– BIZ (+) BRI (+)	.	.	.	.	.	.
– IWF (+) FMI (+)	.	.	.	.	.	.
– Andere internationale Organisationen (+) Autres organisations internationales (+)	.	.	.	.	.	.
b Banken und anderen Finanzinstituten mit Hauptsitz in der Schweiz (+) des banques et d'autres établissements financiers ayant leur siège principal en Suisse (+)	.	.	.	.	.	.
c Banken und anderen Finanzinstituten mit Hauptsitz im Ausland (+) des banques et d'autres établissements financiers ayant leur siège principal à l'étranger (+)	.	.	.	.	.	.
4 Nicht beanspruchte, unbedingte Kreditlimiten gewährt an: Parts non utilisées de lignes de crédit irrévocables, ouvertes en faveur:	.	.	.	.	.	.
a andere nationale Währungsbehörden, BIZ, IWF und andere internationale Organisationen ⁴ d'autres autorités monétaires nationales, de la BRI, du FMI et d'autres organisations internationales ⁴	.	.	.	.	.	.
– andere nationale Währungsbehörden (–) autres autorités monétaires nationales (–)	.	.	.	.	.	.
– BIZ (–) BRI (–)	.	.	.	.	.	.
– IWF (–) FMI (–)	.	.	.	.	.	.
– Andere internationale Organisationen (–) Autres organisations internationales (–)	.	.	.	.	.	.
b Banken und anderen Finanzinstituten mit Hauptsitz in der Schweiz (–) de banques et d'autres établissements financiers ayant leur siège principal en Suisse (–)	.	.	.	.	.	.
c Banken und anderen Finanzinstituten mit Hauptsitz im Ausland (–) de banques et d'autres établissements financiers ayant leur siège principal à l'étranger (–)	.	.	.	.	.	.
5 Total Short- und Long-Positionen von Optionen in fremder Währung gegen Schweizer Franken Total des positions courtes et longues découlant d'options en monnaies étrangères contre francs suisses	—	—	—	—	—	—
a Short-Positionen Positions courtes	—	—	—	—	—	—
i Gekaufte Puts puts achetés	—	—	—	—	—	—
ii Geschriebene Calls calls vendus	—	—	—	—	—	—
b Long-Positionen Positions longues	—	—	—	—	—	—
i Gekaufte Calls calls achetés	—	—	—	—	—	—
ii Geschriebene Puts puts vendus	—	—	—	—	—	—
Pro Memoria: In-the-money-Optionen Pour mémoire: options dans la monnaie						
1 Zu aktuellen Wechselkursen aux cours de change du jour						
a Short-Position position courte	—	—	—	—	—	—
b Long-Position position longue	—	—	—	—	—	—
2 + 5% (Wertabnahme von 5%) + 5% (dépréciation de 5%)						
a Short-Position position courte	—	—	—	—	—	—
b Long-Position position longue	—	—	—	—	—	—

	CHF		in USD en USD	in CHF en CHF		
					Restlaufzeit Durée résiduelle	
					Bis 1 Monat	Über 1 Monat bis 3 Monate
					Jusqu'à 1 mois	Plus de 1 mois à 3 mois
						Über 3 Monate bis 1 Jahr
						Plus de 3 mois à 1 an
		1	2	3	4	5
3 – 5% (Wertzunahme von 5%) – 5% (appréciation de 5%)						
a Short-Position position courte		—	—	—	—	—
b Long-Position position longue		—	—	—	—	—
4 + 10% (Wertabnahme von 10%) + 10% (dépréciation de 10%)						
a Short-Position position courte		—	—	—	—	—
b Long-Position position longue		—	—	—	—	—
5 – 10% (Wertzunahme von 10%) – 10% (appréciation de 10%)						
a Short-Position position courte		—	—	—	—	—
b Long-Position position longue		—	—	—	—	—
6 Übrige autres						
a Short-Position position courte		—	—	—	—	—
b Long-Position position longue		—	—	—	—	—

Pro Memoria / Pour mémoire

IV. Pro Memoria Pour mémoire						
1 a Kurzfristige, wechsellkursindexierte Verpflichtungen in Schweizer Franken Engagements à court terme libellés en francs suisses et indexés sur cours de change		—	—	.	.	.
b Auf Fremdwährung lautende Finanzinstrumente mit anderer Rückzahlung (z. B. in Schweizer Franken) Instruments financiers libellés en monnaies étrangères avec remboursement dans une autre monnaie (en francs suisses par exemple)		—	—	.	.	.
– Derivative Instrumente (Futures und Optionskontrakte) Instruments dérivés (futures et contrats d'options)		—	—	.	.	.
– Short-Position Position courte		—	—	.	.	.
– Long-Position Position longue		—	—	.	.	.
– Übrige Instrumente Autres instruments		—	—	.	.	.
c Verpfändete Wertschriften Titres mis en gage		– 377	– 406	.	.	.
– Bestandteil der Offiziellen Währungsreserven entrant dans les réserves monétaires officielles		– 377	– 406	.	.	.
– Bestandteil der Übrigen Aktiven in Fremdwährung entrant dans les autres actifs en monnaies étrangères		—	—	.	.	.
d Ausgeliehene und für Repogeschäfte eingesetzte Wertschriften: Titres prêtés et mis en pension:		– 56	– 60	.	.	.
– ausgeliehene oder für Repogeschäfte eingesetzte Wertschriften, enthalten in Teil I titres prêtés ou mis en pension et entrant dans la section I		– 9 449	– 10 177	.	.	.
– ausgeliehene oder für Repogeschäfte eingesetzte Wertschriften nicht enthalten in Teil I titres prêtés ou mis en pension et n'entrant pas dans la section I		—	—	.	.	.
– geliehene oder erworbene Wertschriften, enthalten in Teil I titres prêtés ou acquis et entrant dans la section I		—	—	.	.	.
– geliehene oder erworbene Wertschriften, nicht enthalten in Teil I titres prêtés ou acquis et n'entrant pas dans la section I		9 393	10 117	.	.	.

⁴ Bilaterale Abkommen zum Zweck der gegenseitigen Währungshilfe in ausserordentlichen Lagen.
Accords bilatéraux portant sur des aides monétaires mutuelles dans des situations exceptionnelles.

	CHF		in USD en USD	in CHF en CHF	Restlaufzeit Durée résiduelle				
					Bis 1 Monat	Über 1 Monat bis 3 Monate	Über 3 Monate bis 1 Jahr		
					Jusqu'à 1 mois	Plus de 1 mois à 3 mois	Plus de 3 mois à 1 an		
	1		2		3	4	5		
e Derivative Finanzinstrumente (netto, marktbewertet) Instruments financiers dérivés (nets, à leur valeur de marché)			- 119	- 128	.	.	.		
– Forwards forwards			- 150	- 162	.	.	.		
– Futures futures			- 1	- 1	.	.	.		
– Swaps swaps			35	38	.	.	.		
– Optionen options			- 3	- 3	.	.	.		
– Übrige autres			—	—	.	.	.		
f Derivate (Forwards, Futures oder Optionskontrakte), die Margin calls unterliegen und eine Restlaufzeit von mehr als einem Jahr aufweisen Produits dérivés (forwards, futures et contrats d'options) ayant une durée résiduelle supérieure à un an et soumis à un appel de marge			670	722	.	.	.		
– Total kurz- und langfristige Positionen in Forwards und Futures in fremder Währung gegenüber Schweizer Franken (inkl. Terminseite von Devisenswaps) Total des positions courtes et longues résultant de forwards et de futures en monnaies étrangères contre francs suisses (y compris le volet à terme des swaps de change)			670	722	.	.	.		
a Short-Position (–) Position courte (–)			- 496	- 535	.	.	.		
b Long-Position (+) Position longue (+)			1 167	1 257	.	.	.		
– Total Short- und Long-Positionen auf Optionen in fremder Währung gegenüber Schweizer Franken Total des positions courtes et longues résultant d'options en monnaies étrangères contre francs suisses			—	—	.	.	.		
a Short-Position Position courte			—	—	.	.	.		
i Gekaufte Puts puts achetés			—	—	.	.	.		
ii Geschriebene Calls calls vendus			—	—	.	.	.		
b Long-Position Position longue			—	—	.	.	.		
i Gekaufte Calls calls achetés			—	—	.	.	.		
ii Geschriebene Puts puts vendus			—	—	.	.	.		
2 Zusammensetzung der Fremdwährungsreserven (nach Währungsgruppen) Répartition des réserves de devises (groupes de monnaies)			543 544	585 463	.	.	.		
– Währungen aus dem SZR-Währungskorb ⁵ monnaies entrant dans le panier de calcul du DTS ⁵			496 774	535 086	.	.	.		
– Übrige Währungen autres monnaies			46 770	50 377	.	.	.		

⁵ Der SZR-Währungskorb setzt sich aus den Währungen USD, EUR, JPY und GBP zusammen.
Le dollar des Etats-Unis, l'euro, le yen japonais et la livre sterling entrent dans le panier de calcul du DTS.