

PRESSEMITTEILUNG

19. November 2019

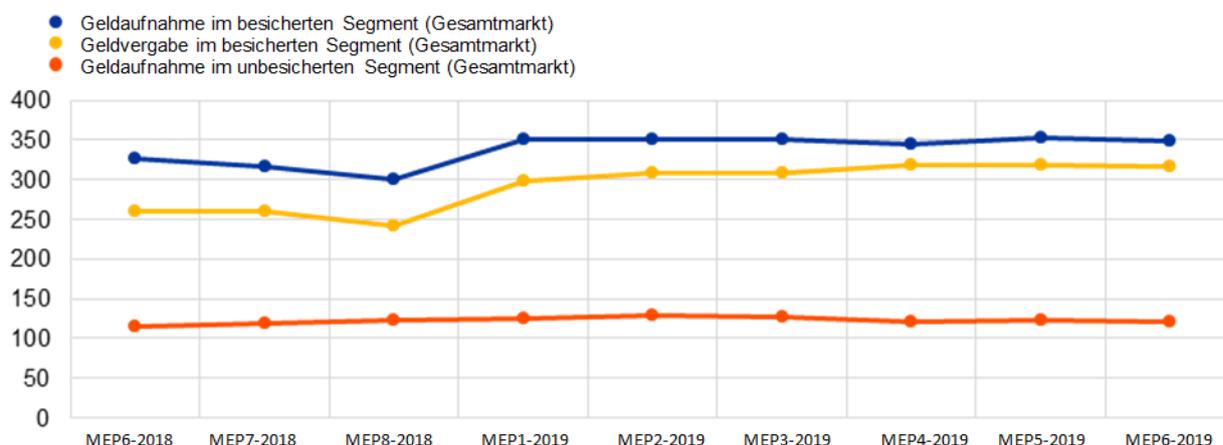
Euro-Geldmarktstatistik: sechste Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2019

- Der [tagesdurchschnittliche Umsatz der Geldaufnahme im unbesicherten Segment](#) verringerte sich von 122 Mrd € in der fünften auf 120 Mrd € in der sechsten Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2019.
- Infolge der vom EZB-Rat für die sechste Mindestreserve-Erfüllungsperiode beschlossenen Änderung des Zinssatzes für die Einlagefazilität sank der [gewichtete durchschnittliche Tagesgeldsatz für Geldaufnahmetransaktionen im unbesicherten Segment](#) am Gesamtmarkt von -0,42 % auf -0,51 % und am Interbankenmarkt von -0,45 % auf -0,54 %.
- Der [tagesdurchschnittliche Umsatz der Geldaufnahme im besicherten Segment](#) ging von 352 Mrd € auf 348 Mrd € zurück, wobei der [gewichtete durchschnittliche Tagesgeldsatz](#) -0,55 % betrug.

Abbildung 1

Tagesdurchschnittlicher Umsatz der nominalen Geldaufnahme und Geldvergabe am besicherten und unbesicherten Geldmarkt nach Mindestreserve-Erfüllungsperiode (MEP)

(in Mrd €)

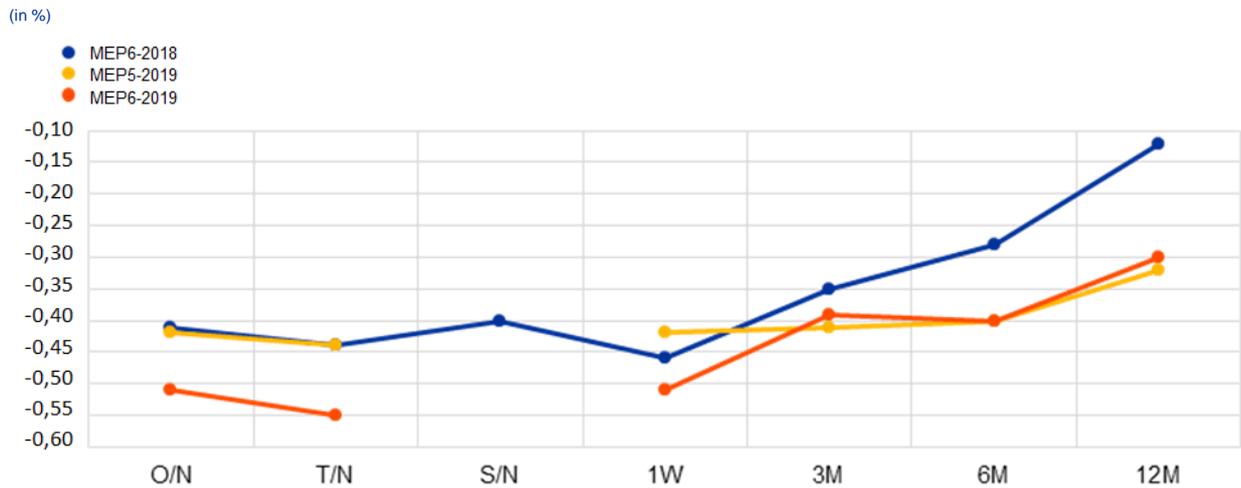


Daten zum tagesdurchschnittlichen Umsatz der nominalen Geldaufnahme und Geldvergabe am besicherten und unbesicherten Geldmarkt sind [hier](#) abrufbar.

Unbesicherter Geldmarkt

Abbildung 2

Gewichteter Durchschnittssatz für die Geldaufnahme im unbesicherten Segment des Gesamtmarkts nach Laufzeit und Mindestreserve-Erfüllungsperiode (MEP)



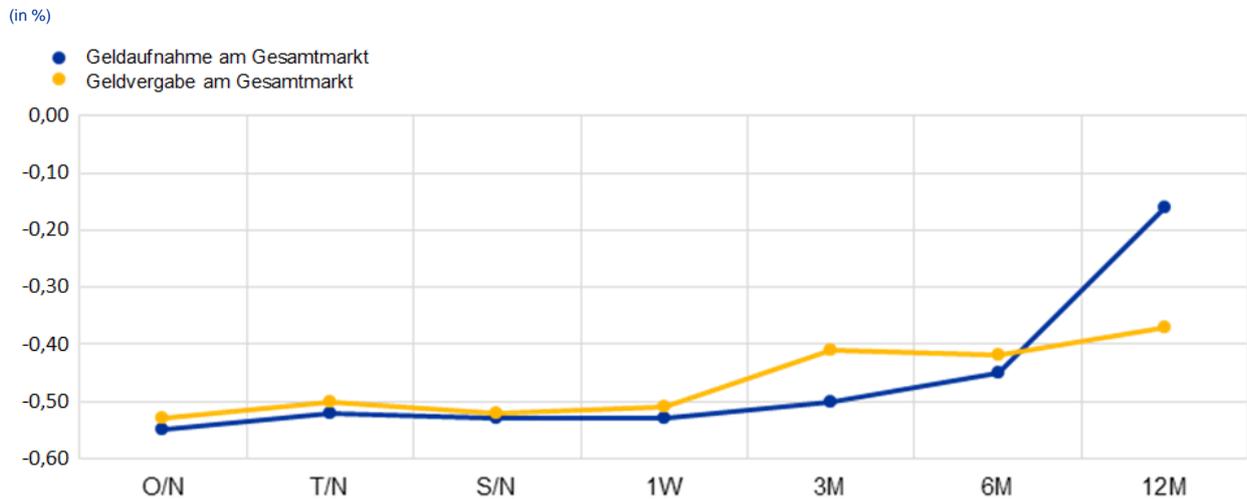
Daten zum gewichteten Durchschnittssatz für die Geldaufnahme am unbesicherten Gesamtmarkt sind [hier](#) abrufbar.

In der sechsten Mindestreserve-Erfüllungsperiode, die am 18. September 2019 begann und am 29. Oktober 2019 endete, lag der Umsatz der Geldaufnahme im unbesicherten Segment im Schnitt bei 120 Mrd € pro Tag. Für die gesamte Erfüllungsperiode wurde er auf 3 612 Mrd € beziffert. Der Umsatz der Geldaufnahme bei Kreditinstituten – d. h. am Interbankenmarkt – betrug 301 Mrd € und entsprach damit 8 % des Gesamtumsatzes der Geldaufnahme, während sich die Geldvergabe an Kreditinstitute auf 225 Mrd € belief. Auf die Geldaufnahme über Transaktionen im Tagesgeldbereich (Overnight-Laufzeit) entfielen 47 % des gesamten aufgenommenen Nominalvolumens. Infolge der vom EZB-Rat für die sechste Mindestreserve-Erfüllungsperiode beschlossenen Änderung des Zinssatzes für die Einlagefazilität lag der gewichtete durchschnittliche Tagesgeldsatz für die Geldaufnahme am Interbankenmarkt bei -0,54 % und am Gesamtmarkt bei -0,51 % nach -0,45 % und -0,42 % in der vorherigen Mindestreserve-Erfüllungsperiode.

Besicherter Geldmarkt

Abbildung 3

Gewichteter Durchschnittssatz für die Geldaufnahme und Geldvergabe im besicherten Segment des Gesamtmarkts nach Laufzeit



Daten zum gewichteten Durchschnittssatz für die Geldaufnahme und Geldvergabe am besicherten Gesamtmarkt sind [hier](#) abrufbar.

In der sechsten Mindestreserve-Erfüllungsperiode lag der Umsatz der Geldaufnahme im besicherten Segment im Schnitt bei 348 Mrd € pro Tag, während er sich für die gesamte Erfüllungsperiode auf 10 435 Mrd € belief. Bei der Geldvergabe betrug der Umsatz insgesamt 9 472 Mrd € und der Tagesdurchschnitt 316 Mrd €. Der Großteil des Umsatzes wurde im Laufzeitbereich von Tagesgeld (Overnight) bis zu einer Woche verzeichnet. Auf den Tagesgeldbereich entfielen rund 20 % und 21 % des gesamten aufgenommenen bzw. vergebenen Nominalvolumens. Infolge der vom EZB-Rat für die sechste Mindestreserve-Erfüllungsperiode beschlossenen Änderung des Zinssatzes für die Einlagefazilität betrug der gewichtete durchschnittliche Tagesgeldsatz für die Geldaufnahme und für die Geldvergabe am Gesamtmarkt -0,55 % und -0,53 % nach -0,47 % und -0,46 % in der vorangegangenen Erfüllungsperiode.

Tabelle 1
Euro-Geldmarktstatistik

		Umsatz (in Mrd €)				Durchschnittlicher Tagesgeldsatz (in %)	
		Tagesdurchschnitt		Insgesamt			
		MEP 5 2019	MEP 6 2019	MEP 5 2019	MEP 6 2019	MEP 5 2019	MEP 6 2019
Unbesicherter Geldmarkt	Geldaufnahme am Gesamtmarkt	122	120	4 270	3 612	-0,42	-0,51
	Davon: Interbankenmarkt	10	10	367	301	-0,45	-0,54
	Geldvergabe am Interbankenmarkt	6	7	211	225	-0,36	-0,43
Besicherter Geldmarkt	Geldaufnahme am Gesamtmarkt	352	348	12 331	10 435	-0,47	-0,55
	Geldvergabe am Gesamtmarkt	318	316	11 123	9 472	-0,46	-0,53

Mediananfragen sind an Herrn [Stefan Ruhkamp](#) zu richten (Tel. +49 69 1344 5057).

Anmerkung

- Die Daten zur Geldmarktstatistik sind über das [Statistical Data Warehouse \(SDW\) der EZB](#) abrufbar.
- Das Eurosystem erhebt von den – gemessen am Gesamtbetrag ihrer wesentlichen Bilanzaktiva – 50 größten Banken im Euro-Währungsgebiet Daten auf Einzeltransaktionsbasis, untergliedert in Geldaufnahme und Geldvergabe. Die unbesicherten Transaktionen umfassen alle Handelsgeschäfte, die über Einlagen, Tagesgeldkonten (call accounts) und kurzfristige Wertpapiere mit finanziellen Kapitalgesellschaften (außer Zentralbanken, wo die Transaktion keinem Anlagezweck dient), dem Staat und nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die gemäß dem Basel-III-Rahmenwerk zur Mindestliquiditätsquote (LCR) als Großkunden gelten, getätigt wurden. Zu den besicherten Transaktionen zählen alle Repogeschäfte mit fester Laufzeit und Open Repos sowie Geschäfte (einschließlich Drei-Parteien-Repogeschäften (tri-party repos)), die im Rahmen eines Repogeschäfts zwischen dem Meldepflichtigen und finanziellen Kapitalgesellschaften (außer Zentralbanken, wo die Transaktion keinem Anlagezweck dient), dem Staat und nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die gemäß dem Basel-III-Rahmenwerk zur Mindestliquiditätsquote (LCR) als Großkunden gelten, in Euro mit einer Laufzeit von bis zu einem Jahr abgeschlossen wurden. Ab der ersten Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2019 umfasst der Gesamtmarkt alle Gegenparteien der aufgeführten Sektoren. Weitere Informationen über die angewandte Methodik, einschließlich einer Auflistung der Meldepflichtigen, stehen auf der Website der EZB [im Abschnitt „Statistics“](#) zur Verfügung.
- Der gewichtete Durchschnittssatz wird anhand des mit dem jeweiligen Nominalvolumen gewichteten arithmetischen Mittels der Zinssätze über die Mindestreserve-Erfüllungsperiode an allen Tagen, an denen TARGET2 (das transeuropäische automatisierte Echtzeit-Brutto-Express-Zahlungssystem) offen ist, berechnet.
- Die Geldaufnahme bezieht sich auf Transaktionen, bei denen die meldepflichtige Bank auf Euro lautende Mittel erhält, unabhängig davon, ob die Transaktion vom berichtspflichtigen Institut oder von der Gegenpartei initiiert wurde.

- Die Geldvergabe bezieht sich auf Transaktionen, bei denen die meldepflichtige Bank auf Euro lautende Mittel bereitstellt, unabhängig davon, ob die Transaktion vom berichtspflichtigen Institut oder von der Gegenpartei initiiert wurde.
- Die Abkürzungen O/N, T/N, S/N, 1W, 3M, 6M und 12M stehen für „Overnight“, „Tomorrow/Next“, „Spot/Next“, „eine Woche“, „drei Monate“, „sechs Monate“ und „zwölf Monate“.
- Das Fehlen von Werten für Laufzeiten bei einigen Mindestreserve-Erfüllungsperioden kann auf die Einhaltung von Vertraulichkeitsanforderungen zurückzuführen sein.
- Neben den Entwicklungen in der letzten Mindestreserve-Erfüllungsperiode enthält diese Pressemitteilung auch leicht revidierte Daten zu vorangegangenen Erfüllungsperioden.
- Die Daten werden 15 Arbeitstage nach dem Ende der entsprechenden Erfüllungsperiode zur Verfügung gestellt. Der [Veröffentlichungskalender](#) und die [unverbindlichen Kalender für die Mindestreserve-Erfüllungsperioden des Eurosystems](#) sind auf der Website der EZB abrufbar.
- Die nächste Pressemitteilung zu den Daten der Euro-Geldmarktstatistik erscheint am 10. Januar 2020.

Europäische Zentralbank

Generaldirektion Kommunikation

Sonnemannstraße 20, 60314 Frankfurt am Main, Deutschland

Tel.: +49 69 1344 7455, E-Mail: media@ecb.europa.eu

Internet: www.ecb.europa.eu

Nachdruck nur mit Quellenangabe gestattet.