

PRESSEMITTEILUNG

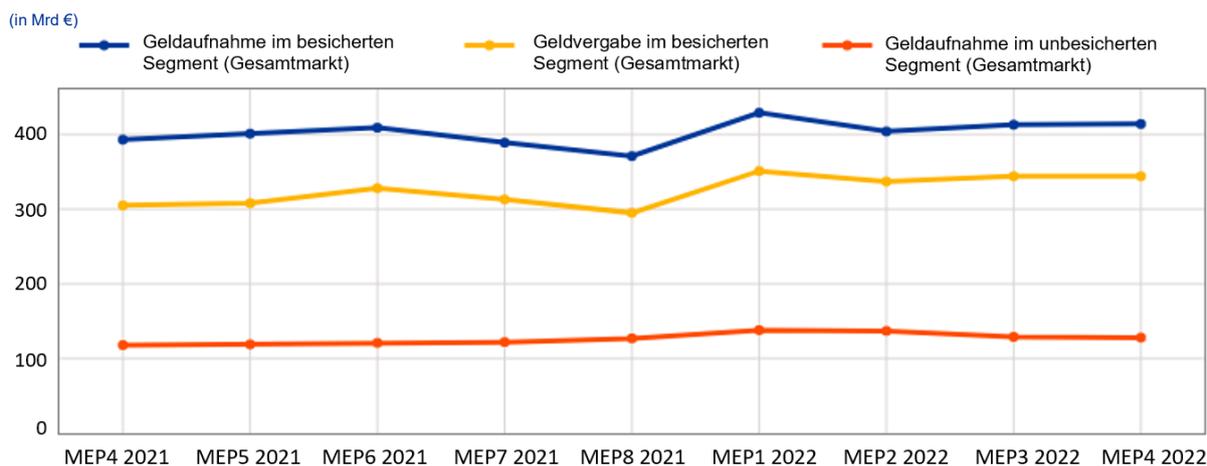
16. August 2022

Euro-Geldmarktstatistik: vierte Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2022

- Der [tagesdurchschnittliche Umsatz der Geldaufnahme im unbesicherten Segment](#) sank von 129 Mrd € in der dritten Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2022 auf 128 Mrd € in der vierten Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2022.
- Der [gewichtete durchschnittliche Tagesgeldsatz für die Geldaufnahme im unbesicherten Segment](#) erhöhte sich am Gesamtmarkt von -0,55 % auf -0,53 % und blieb am Interbankenmarkt stabil bei -0,59 %.
- Der [tagesdurchschnittliche Umsatz der Geldaufnahme im besicherten Segment](#) nahm von 413 Mrd € auf 414 Mrd € zu, wobei der [gewichtete durchschnittliche Tagesgeldsatz](#) -0,90 % betrug.

Abbildung 1

Tagesdurchschnittlicher Umsatz der nominalen Geldaufnahme und Geldvergabe im besicherten und unbesicherten Segment des Gesamtmarkts nach Mindestreserve-Erfüllungsperiode (MEP)

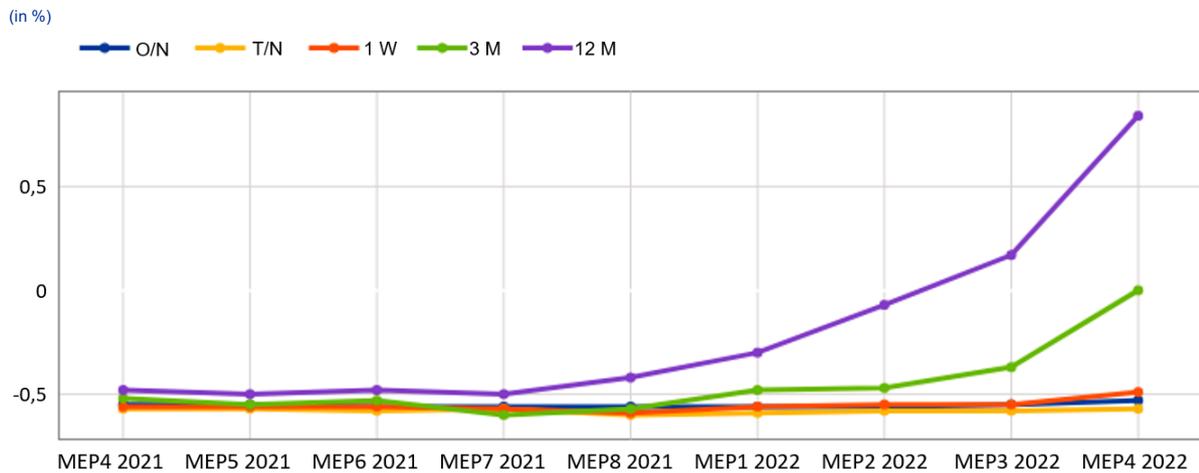


Daten zum tagesdurchschnittlichen Umsatz der nominalen Geldaufnahme und Geldvergabe am besicherten und unbesicherten Geldmarkt sind [hier](#) abrufbar.

Unbesicherter Geldmarkt

Abbildung 2

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



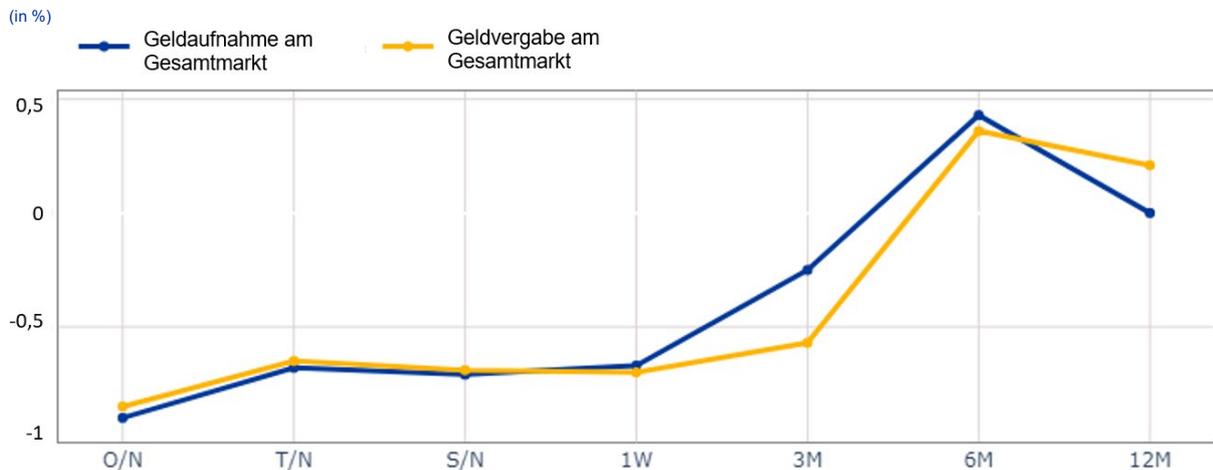
Daten zum gewichteten Durchschnittssatz für die Geldaufnahme am unbesicherten Gesamtmarkt sind [hier](#) abrufbar.

In der vierten Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2022, die am 15. Juni 2022 begann und am 26. Juli 2022 endete, lag der Umsatz der Geldaufnahme im unbesicherten Segment bei durchschnittlich 128 Mrd € pro Tag. Für die gesamte Erfüllungsperiode wurde er auf insgesamt 3 849 Mrd € beziffert. Der Umsatz der Geldaufnahme bei Kreditinstituten – d. h. am Interbankenmarkt – betrug 341 Mrd € und entsprach damit einem Anteil von 9 % des Gesamtumsatzes der Geldaufnahme. Die Geldvergabe an Kreditinstitute belief sich auf 261 Mrd €. Auf die Geldaufnahme über Transaktionen im Tagesgeldbereich (Overnight-Laufzeit) entfielen 70 % des insgesamt aufgenommenen Nominalvolumens. Der gewichtete durchschnittliche Tagesgeldsatz für die Geldaufnahme lag am Interbankenmarkt bei -0,59 % und am Gesamtmarkt bei -0,53 %, verglichen mit -0,59 % bzw. -0,55 % in der vorangegangenen Mindestreserve-Erfüllungsperiode.

Besicherter Geldmarkt

Abbildung 3

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



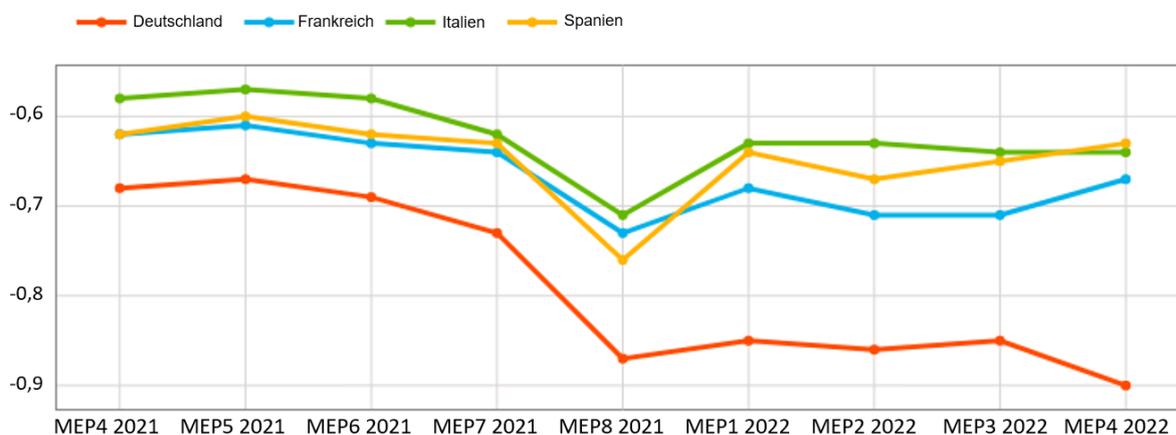
Daten zum gewichteten Durchschnittssatz für die Geldaufnahme und Geldvergabe am besicherten Gesamtmarkt sind [hier](#) abrufbar.

In der vierten Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2022 lag der Umsatz der Geldaufnahme im besicherten Segment tagesdurchschnittlich bei 414 Mrd € und insgesamt bei 12 410 Mrd €. Bei der Geldvergabe betrug der Umsatz tagesdurchschnittlich 344 Mrd € und insgesamt 10 319 Mrd €. Der Großteil des Umsatzes wurde in den Laufzeitbereichen von Tagesgeld (Overnight) bis zu einer Woche verzeichnet. Auf den Tagesgeldbereich entfielen rund 25 % des insgesamt aufgenommenen und rund 22 % des insgesamt vergebenen Nominalvolumens. Der gewichtete durchschnittliche Tagesgeldsatz am Gesamtmarkt betrug -0,90 % für die Geldaufnahme und -0,85 % für die Geldvergabe, verglichen mit -0,74 % bzw. -0,71 % in der vorangegangenen Erfüllungsperiode. Der gewichtete Durchschnittssatz für die Geldaufnahme mit Spot/Next-Laufzeit lag in der vierten Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2022 zwischen -0,63 % (für Transaktionen basierend auf in Spanien emittierten Sicherheiten) und -0,90 % (für Transaktionen basierend auf in Deutschland emittierten Sicherheiten).

Abbildung 4

Gewichteter Durchschnittssatz für die Geldaufnahme mit Spot/Next-Laufzeit im besicherten Segment nach Emissionsland der Sicherheiten und Mindestreserve-Erfüllungsperiode (MEP)

(in %)



Daten zum gewichteten Durchschnittssatz für die Geldaufnahme im besicherten Segment am Gesamtmarkt nach Land des Emittenten der Sicherheit sind [hier](#) abrufbar.

Tabelle 1

Euro-Geldmarktstatistik

		Umsatz (in Mrd €)				Durchschnittlicher Tagesgeldsatz (in %)	
		Tagesdurchschnitt		Insgesamt			
		MEP 3 2022	MEP 4 2022	MEP 3 2022	MEP 4 2022	MEP 3 2022	MEP 4 2022
Unbesicherter Geldmarkt	Geldaufnahme am Gesamtmarkt	129	128	5 141	3 849	-0,55	-0,53
	Davon: Interbankenmarkt	11	11	430	341	-0,59	-0,59
	Geldvergabe am Interbankenmarkt	8	9	310	261	-0,41	-0,41
Besicherter Geldmarkt	Geldaufnahme am Gesamtmarkt	413	414	16 511	12 410	-0,74	-0,90
	Geldvergabe am Gesamtmarkt	344	344	13 753	10 319	-0,71	-0,85

Mediananfragen sind an [Philippe Rispal](#) zu richten (Tel. +49 69 1344 5482).

Anmerkung

- Die Daten zur Geldmarktstatistik sind über das [Statistical Data Warehouse \(SDW\) der EZB](#) abrufbar.
- Das Eurosystem erhebt von den 47 größten Banken im Euro-Währungsgebiet (gemessen am Gesamtbetrag ihrer wesentlichen Bilanzaktiva) 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 (ausgenommen Zentralbanken in den Fällen, in denen 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 (ausgenommen Zentralbanken in den Fällen, in denen 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 Banken, 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) geöffnet ist, berechnet.
- Die Geldaufnahme bezieht sich auf Transaktionen, bei denen die meldepflichtige Bank auf Euro lautende Mittel erhält, unabhängig davon, ob die Transaktion von ihr selbst 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 von ihr selbst 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“.
- Die Angaben zum Land des Emittenten der Sicherheit beziehen sich auf die Gebietsansässigkeit des Emittenten für Transaktionen, die durch Einzelsicherheiten mit International Securities Identification Number (ISIN) besichert werden.
- 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 veröffentlicht. 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 4. Oktober 2022.

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.