



PRESSEMITTEILUNG

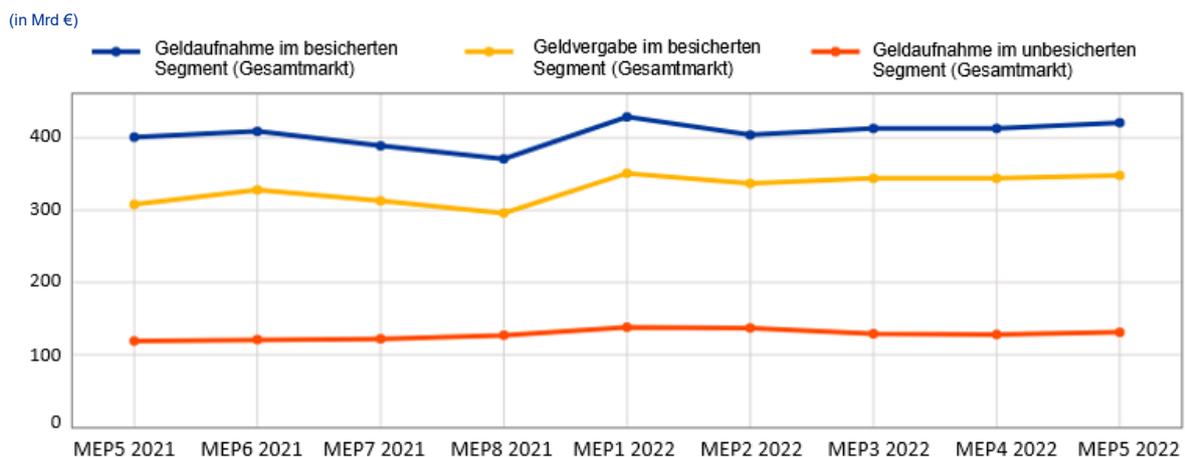
4. Oktober 2022

Euro-Geldmarktstatistik: fünfte Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2022

- Der [tagesdurchschnittliche Umsatz der Geldaufnahme im unbesicherten Segment](#) stieg von 128 Mrd € in der vierten Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2022 auf 131 Mrd € in der fünften Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2022.
- Der [gewichtete durchschnittliche Tagesgeldsatz für die Geldaufnahme im unbesicherten Segment](#) erhöhte sich am Gesamtmarkt von -0,53 % auf -0,04 % und am Interbankenmarkt von -0,59 % auf -0,03 %.
- Der [tagesdurchschnittliche Umsatz der Geldaufnahme im besicherten Segment](#) nahm von 413 Mrd € auf 421 Mrd € zu, wobei der [gewichtete durchschnittliche Tagesgeldsatz](#) -0,44 % betrug.

Abbildung 1

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

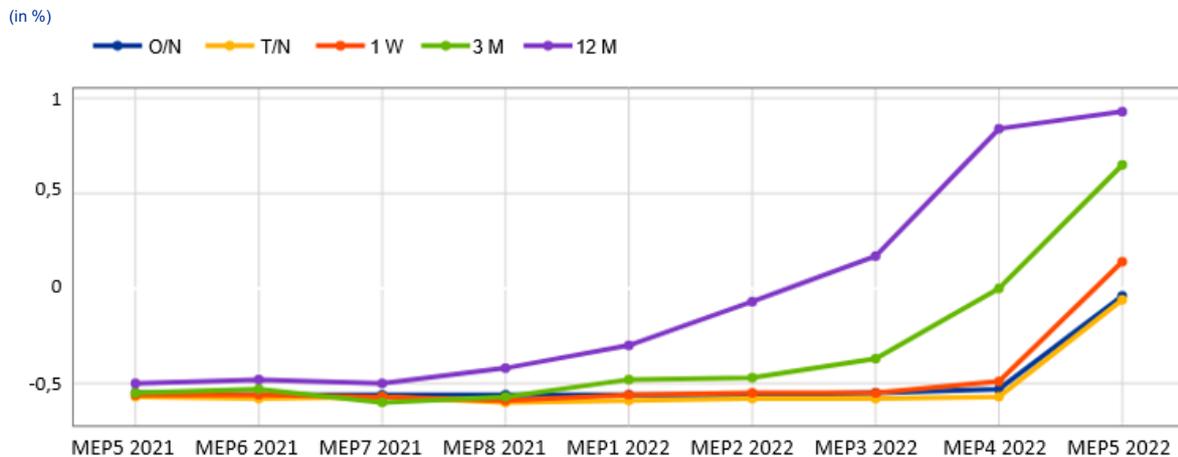


Daten zum tagesdurchschnittlichen Umsatz der nominalen Geldaufnahme und Geldvergabe am besicherten und unbesicherten Geldmarkt sind [hier](#) abrufbar.

Unbesicherter Geldmarkt

Abbildung 2

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



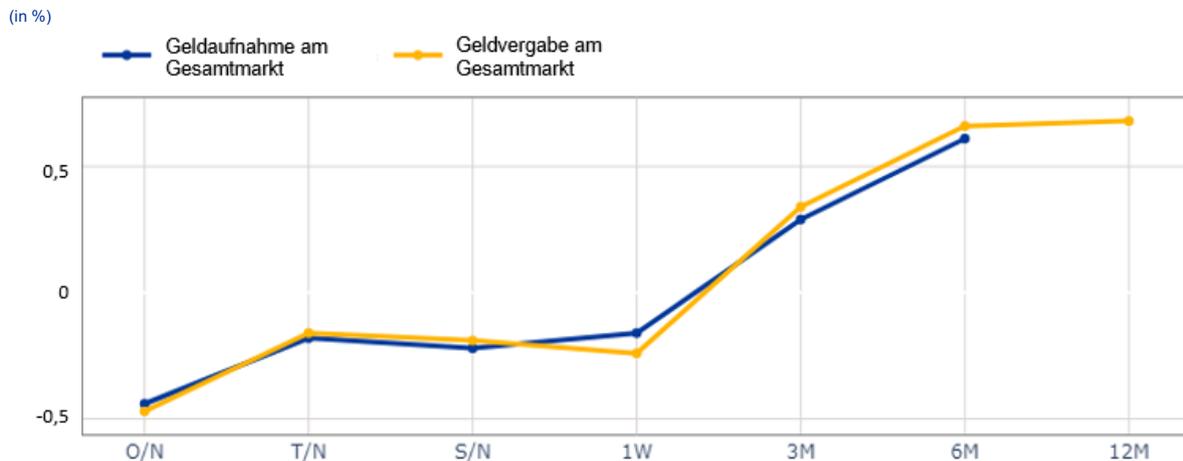
Daten zum gewichteten Durchschnittssatz für die Geldaufnahme am unbesicherten Gesamtmarkt sind [hier](#) abrufbar.

In der fünften Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2022, die am 27. Juli 2022 begann und am 13. September 2022 endete, lag der Umsatz der Geldaufnahme im unbesicherten Segment bei tagesdurchschnittlich 131 Mrd € und insgesamt bei 4 600 Mrd €. Der Umsatz der Geldaufnahme bei Kreditinstituten – d. h. am Interbankenmarkt – betrug 642 Mrd € und entsprach damit einem Anteil von 14% des Gesamtumsatzes der Geldaufnahme. Die Geldvergabe an Kreditinstitute belief sich auf 141 Mrd €. Auf die Geldaufnahme über Transaktionen im Tagesgeldbereich (Overnight-Laufzeit) entfielen 71 % des insgesamt aufgenommenen Nominalvolumens. Der gewichtete durchschnittliche Tagesgeldsatz für die Geldaufnahme lag am Interbankenmarkt bei -0,03 % und am Gesamtmarkt bei -0,04 %, verglichen mit -0,59 % bzw. -0,53 % in der vorangegangenen Mindestreserve-Erfüllungsperiode.

Besicherter Geldmarkt

Abbildung 3

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



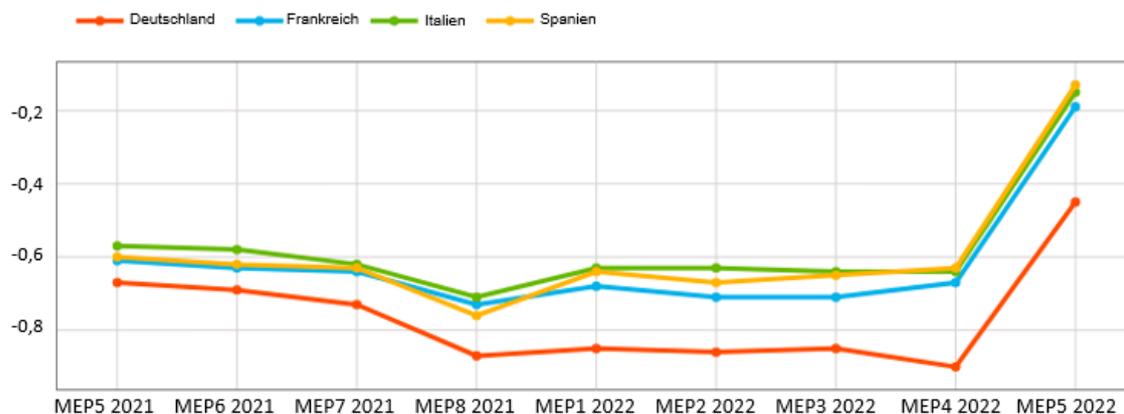
Daten zum gewichteten Durchschnittssatz für die Geldaufnahme und Geldvergabe am besicherten Gesamtmarkt sind [hier](#) abrufbar.

In der fünften Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2022 lag der Umsatz der Geldaufnahme im besicherten Segment tagesdurchschnittlich bei 421 Mrd € und insgesamt bei 14 730 Mrd €. Bei der Geldvergabe betrug der Umsatz tagesdurchschnittlich 348 Mrd € und insgesamt 12 184 Mrd €. Der Großteil des Umsatzes wurde in den Laufzeitbereichen von Tagesgeld (Overnight) bis zu einer Woche verzeichnet. Auf den Tagesgeldbereich entfielen rund 26 % des insgesamt aufgenommenen und rund 23 % des insgesamt vergebenen Nominalvolumens. Der gewichtete durchschnittliche Tagesgeldsatz am Gesamtmarkt betrug -0,44 % für die Geldaufnahme und -0,47 % für die Geldvergabe, verglichen mit -0,90 % bzw. -0,85 % in der vorangegangenen Erfüllungsperiode. Der gewichtete Durchschnittssatz für die Geldaufnahme mit Spot/Next-Laufzeit lag in der fünften Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2022 zwischen -0,13 % (für Transaktionen basierend auf in Spanien emittierten Sicherheiten) und -0,45 % (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 4 2022	MEP 5 2022	MEP 4 2022	MEP 5 2022	MEP 4 2022	MEP 5 2022
Unbesicherter Geldmarkt	Geldaufnahme am Gesamtmarkt	128	131	3 849	4 600	-0,53	-0,04
	Davon: Interbankenmarkt	11	18	341	642	-0,59	-0,03
	Geldvergabe am Interbankenmarkt	9	4	261	141	-0,41	-0,02
Besicherter Geldmarkt	Geldaufnahme am Gesamtmarkt	413	421	12 398	14 730	-0,90	-0,44
	Geldvergabe am Gesamtmarkt	344	348	10 319	12 184	-0,85	-0,47

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 22. November 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.