

Pressemitteilung

5. Oktober 2021

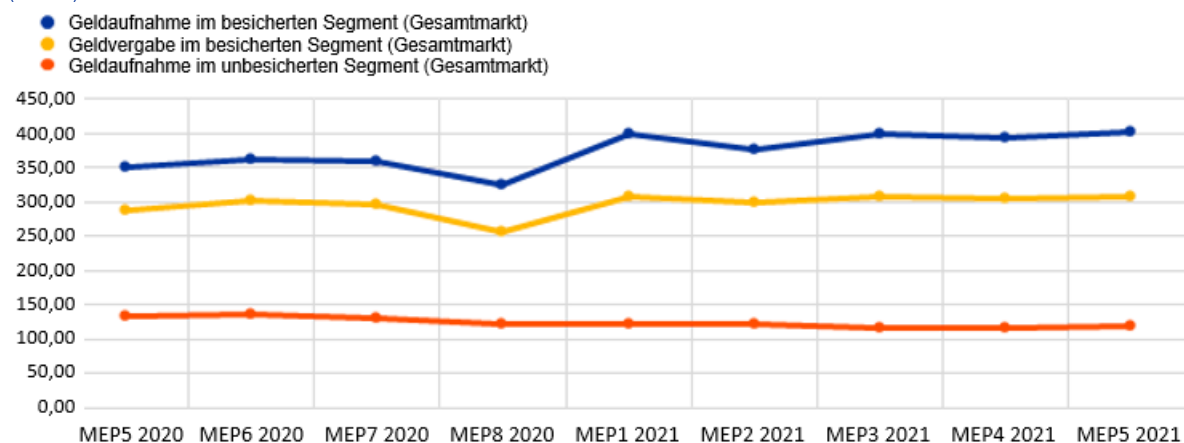
Euro-Geldmarktstatistik: fünfte Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2021

- Der [tagesdurchschnittliche Umsatz der Geldaufnahme im unbesicherten Segment](#) stieg von 117 Mrd € in der vierten Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2021 auf 119 Mrd € in der fünften Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2021.
- Der [gewichtete durchschnittliche Tagesgeldsatz für Geldaufnahmetransaktionen im unbesicherten Segment](#) lag am Gesamtmarkt unverändert bei -0,55 % und verringerte sich am Interbankenmarkt geringfügig von -0,56 % auf -0,57 %.
- Der [tagesdurchschnittliche Umsatz der Geldaufnahme im besicherten Segment](#) erhöhte sich von 393 Mrd € auf 402 Mrd €, 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 €)

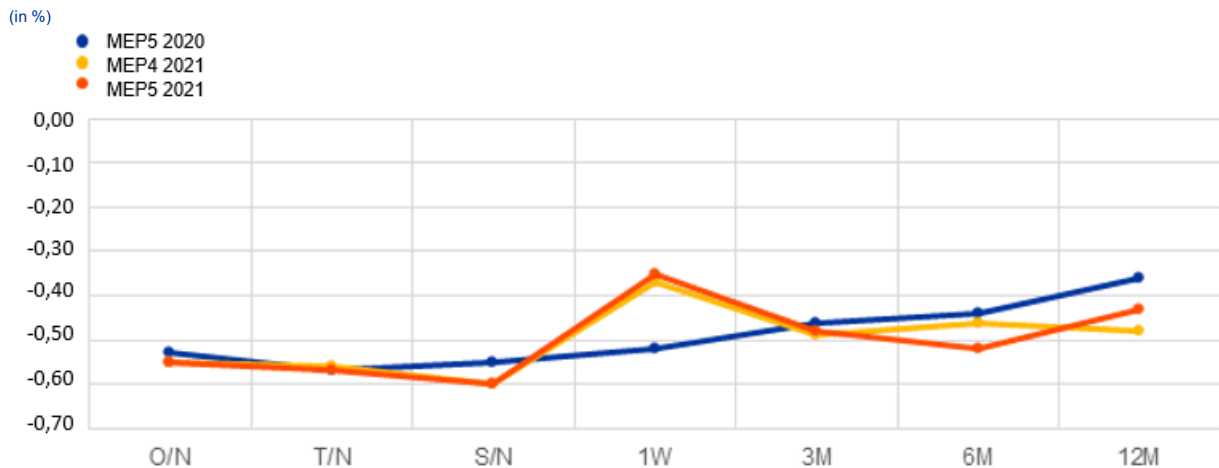


Daten zum tagesdurchschnittlichen Umsatz der nominalen Geldaufnahme und Geldvergabe am besicherten und unbesicherten Geldmarkt sind [hier](#) abrufbar.

Unbesicherter Geldmarkt

Abbildung 2

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



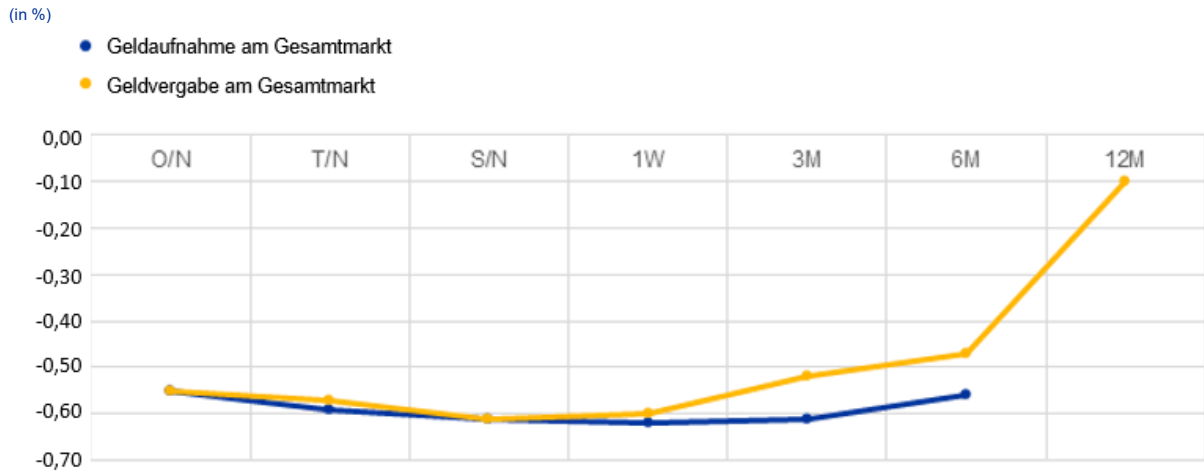
Daten zum gewichteten Durchschnittssatz für die Geldaufnahme am unbesicherten Gesamtmarkt sind [hier](#) abrufbar.

In der fünften Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2021, die am 28. Juli 2021 begann und am 14. September 2021 endete, lag der Umsatz der Geldaufnahme im unbesicherten Segment bei durchschnittlich 119 Mrd € pro Tag. Für die gesamte Erfüllungsperiode wurde er auf insgesamt 4 167 Mrd € beziffert. Der Umsatz der Geldaufnahme bei Kreditinstituten – d. h. am Interbankenmarkt – betrug 457 Mrd € und entsprach damit einem Anteil von 11 % des Gesamtumsatzes der Geldaufnahme, während sich die Geldvergabe an Kreditinstitute auf 198 Mrd € belief. Auf die Geldaufnahme über Transaktionen im Tagesgeldbereich (Overnight-Laufzeit) entfielen 66 % des insgesamt aufgenommenen Nominalvolumens. Der gewichtete durchschnittliche Tagesgeldsatz für die Geldaufnahme lag am Interbankenmarkt bei -0,57 % und am Gesamtmarkt bei -0,55 %, verglichen mit -0,56 % bzw. -0,55 % 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 fünften Mindestreserve-Erfüllungsperiode 2021 lag der Umsatz der Geldaufnahme im besicherten Segment tagesdurchschnittlich bei 402 Mrd € und insgesamt bei 14 073 Mrd €. Bei der Geldvergabe betrug der Umsatz tagesdurchschnittlich 309 Mrd € und insgesamt 10 808 Mrd €. Der Großteil des Umsatzes wurde in den Laufzeitbereichen von Tagesgeld (Overnight) bis zu einer Woche verzeichnet. Auf den Tagesgeldbereich entfielen rund 27 % des insgesamt aufgenommenen und rund 25 % des insgesamt vergebenen Nominalvolumens. Der gewichtete durchschnittliche Tagesgeldsatz für die Geldaufnahme und die Geldvergabe am Gesamtmarkt betrug wie bereits in der vorangegangenen Erfüllungsperiode jeweils -0,55 %.

Tabelle 1
Euro-Geldmarktstatistik

		Umsatz (in Mrd €)				Durchschnittlicher Tagesgeldsatz (in %)	
		Tagesdurchschnitt		Insgesamt			
		MEP 4 2021	MEP 5 2021	MEP 4 2021	MEP 5 2021	MEP 4 2021	MEP 5 2021
Unbesicherter Geldmarkt	Geldaufnahme am Gesamtmarkt	117	119	3 525	4 167	-0,55	-0,55
	Davon: Interbankenmarkt	12	13	356	457	-0,56	-0,57
	Geldvergabe am Interbankenmarkt	6	6	194	198	-0,43	-0,42
Besicherter Geldmarkt	Geldaufnahme am Gesamtmarkt	393	402	11 790	14 073	-0,55	-0,55
	Geldvergabe am Gesamtmarkt	306	306	9 173	10 808	-0,55	-0,55

Medianfragen 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 – gemessen am Gesamtbetrag ihrer wesentlichen Bilanzaktiva – 47 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) 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“.
- 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 23. November 2021.

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.