

## Kommunikation

Postfach, CH-8022 Zürich  
Telefon +41 1 631 31 11  
Telefax +41 1 631 39 10  
www.snb.ch  
snb@.snb.ch

Zürich, 17. Januar 2005

## Medienmitteilung

# Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 14. Januar 2005

### Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

| Aktiven (in Mio. Franken)                                       | 14. Januar 2005 | Veränderungen<br>gegenüber Vorwoche |
|---|-----------------|-------------------------------------|
| Forderungen aus Hauptfinanzierungs-<br>und Feinsteuergeschäften | 20'201.0        | -807.0                              |
| Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität                 | 0.4             | +0.4                                |
| <b>Passiven (in Mio. Franken)</b>                               |                 |                                     |
| Notenumlauf   | 37'263.1        | -924.1                              |
| Girokonten inländischer Banken                                  | 5'640.9         | +236.7                              |
| Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften                    | 0.0             | 0.0                                 |

### Referenzzinssätze SNB

| Datum    | Zielband für<br>Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor | Sondersatz<br>Engpassfinanzierungsfazität <sup>1</sup> |
|----------|----------------------------------|------------------|--|
| 10.01.05 | 0.25% - 1.25%                    | 0.73000%         | 2.66%  |
| 11.01.05 | 0.25% - 1.25%                    | 0.73333%         | 2.66%  |
| 12.01.05 | 0.25% - 1.25%                    | 0.74333%         | 2.64%  |
| 13.01.05 | 0.25% - 1.25%                    | 0.74000%         | 2.74%  |
| 14.01.05 | 0.25% - 1.25%                    | 0.75000%         | 2.75%  |

<sup>1</sup> Repo-Overnight-Index (SNB) vom Vortag + 2%  
Der Lombardsatz entspricht bis Ende 2005 dem Sondersatz.

### Repo-Overnight-Index (SNB)

| Datum    | Referenzzinssatz<br>(gewichtet) <sup>2</sup> | Tageshöchst | Tagestiefst | Handelsvolumen<br>in Mio. Franken | Anzahl<br>Geschäfte |
|----------|--|-------------|-------------|-----------------------------------|---------------------|
| 10.01.05 | 0.66%  | 0.70%       | 0.62%       | 2'499                             | 45                  |

|          |       |       |       |       |    |
|----------|-------|-------|-------|-------|----|
| 11.01.05 | 0.64% | 0.70% | 0.60% | 2'482 | 44 |
| 12.01.05 | 0.74% | 0.85% | 0.68% | 2'130 | 41 |
| 13.01.05 | 0.75% | 0.80% | 0.70% | 1'246 | 31 |
| 14.01.05 | 0.64% | 0.80% | 0.45% | 1'252 | 32 |

---

<sup>2</sup> Definition siehe [www.snb.ch](http://www.snb.ch) (Aktuelles, Geldpolitisch wichtige Daten)

**Tagesergebnisse der geldpolitischen Geschäfte** (in Mio. Franken)

| Abschluss | SNB <sup>3</sup> | Kontrakt | von      | bis      | Art       | Preis <sup>4</sup> | Gebote | Zuteilung |
|-----------|------------------|----------|----------|----------|-----------|--------------------|--------|-----------|
| 10.01.05  | GG               | 1W       | 12.01.05 | 19.01.05 | R-Auktion | 0.59%              | 44'766 | 2'000     |
| 11.01.05  | GG               | 1W       | 13.01.05 | 20.01.05 | R-Auktion | 0.60%              | 27'307 | 3'500     |
| 11.01.05  | GG               | 2W       | 13.01.05 | 27.01.05 | R-Auktion | 0.60%              | 24'375 | 3'000     |
| 12.01.05  | GG               | 1W       | 14.01.05 | 21.01.05 | R-Auktion | 0.60%              | 46'233 | 5'501     |
| 13.01.05  | GG               | 1W       | 17.01.05 | 24.01.05 | R-Auktion | 0.60%              | 40'810 | 3'001     |
| 14.01.05  | GG               | 1W       | 18.01.05 | 25.01.05 | R-Auktion | 0.60%              | 56'152 | 2'998     |

---

<sup>3</sup> GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

<sup>4</sup> bei bilateralen Geschäften: Durchschnittssatz; bei Swaps: Terminauf- bzw. abschläge (Pips)