

Kommunikation

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

Zürich, 24. Januar 2005

Medienmitteilung

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 21. Januar 2005

Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

Aktiven (in Mio. Franken)	21. Januar 2005	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	18'500.0	-1'701.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	-0.4
Passiven (in Mio. Franken)		
Notenumlauf	36'816.4	-446.7
Girokonten inländischer Banken	4'361.7	-1'279.2
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität ¹
17.01.05	0.25% - 1.25%	0.74333%	2.64%
18.01.05	0.25% - 1.25%	0.73833%	2.58%
19.01.05	0.25% - 1.25%	0.73000%	2.25%
20.01.05	0.25% - 1.25%	0.73000%	2.09%
21.01.05	0.25% - 1.25%	0.74000%	2.58%

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

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode (in Mio. Franken) ²

vergangene Unterlegungsperiode		laufende Unterlegungsperiode	
Durchschnitt bis	Giroguthaben	Durchschnitt bis	Giroguthaben

Schlusswert
Periode

² Die Unterlegungsperiode dauert vom 20. eines Monats bis zum 19. des Folgemonats

Mindestreserven: Erfüllung für die letzten 12 Unterlegungsperioden (in Mio. Franken)

Periode	Erfordernis	anrechenbare Aktiven ³	Noten Münzen	Giroguthaben	Erfüllungsgrad in %
-					
-					
-					
-					
-					

³ Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben

Repo-Overnight-Index (SNB)

Datum	Referenzsatz (gewichtet) ⁴	Tageshöchst	Tagestiefst	Handelsvolumen in Mio. Franken	Anzahl Geschäfte
17.01.05	0.58%	0.66%	0.40%	1'253	24
18.01.05	0.25%	0.42%	0.05%	2'041	28
19.01.05	0.09%	0.20%	0.05%	954	24
20.01.05	0.58%	0.63%	0.53%	2'091	33
21.01.05	0.60%	0.64%	0.55%	3'240	51

⁴ Definition siehe www.snb.ch (Aktuelles, Geldpolitisch wichtige Daten)

Tagesergebnisse der geldpolitischen Geschäfte (in Mio. Franken)

Abschluss	SNB ⁵	Kontrakt	von	bis	Art	Preis ⁶	Gebote	Zuteilung
17.01.05	GG	1W	19.01.05	26.01.05	R-Auktion	0.60%	48'105	1'500
18.01.05	GG	1W	20.01.05	27.01.05	R-Auktion	0.59%	30'235	2'500
19.01.05	GG	1W	21.01.05	28.01.05	R-Auktion	0.59%	43'605	5'501
20.01.05	GG	1W	24.01.05	31.01.05	R-Auktion	0.60%	28'365	3'500
21.01.05	GG	1W	25.01.05	01.02.05	R-Auktion	0.60%	50'514	3'000

⁵ GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

⁶ bei bilateralen Geschäften: Durchschnittssatz; bei Swaps: Terminauf- bzw. abschläge (Pips)

