

Kommunikation

Postfach, CH-8022 Zürich
Telefon +41 44 631 31 11
Telefax +41 44 631 39 10
www.snb.ch
snb@snb.ch

Zürich, 17. Oktober 2005

Medienmitteilung

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 14. Oktober 2005

Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

Aktiven (in Mio. Franken)	14. Oktober 2005	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	19'800.0	-500.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
Passiven (in Mio. Franken)		
Notenumlauf	36'338.9	-521.2
Girokonten inländischer Banken	5'034.7	-778.6
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität ¹
10.10.05	0.25% - 1.25%	0.80000%	2.69%
11.10.05	0.25% - 1.25%	0.80000%	2.70%
12.10.05	0.25% - 1.25%	0.80000%	2.70%
13.10.05	0.25% - 1.25%	0.80000%	2.70%
14.10.05	0.25% - 1.25%	0.80000%	2.69%

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

26.08.05	4'515	23.09.05	4'734
02.09.05	4'539	30.09.05	4'681
09.09.05	4'544	07.10.05	4'813
16.09.05	4'499	14.10.05	4'877
Schlusswert Periode	4'457		

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	Giro- guthaben	Erfüllungs- grad in %	Zinssatz ⁴
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
20.01.05 - 19.02.05	7'343	9'343	4'462	4'881	127	3.72%
20.02.05 - 19.03.05	7'431	9'260	4'494	4'766	125	3.72%
20.03.05 - 19.04.05	7'504	9'378	4'606	4'771	125	3.74%
20.04.05 - 19.05.05	7'627	9'548	4'599	4'949	125	3.74%
20.05.05 - 19.06.05	7'666	9'158	4'569	4'589	119	3.73%
20.06.05 - 19.07.05	7'682	9'206	4'676	4'530	120	3.73%
20.07.05 - 19.08.05	7'616	9'122	4'632	4'490	120	3.74%

³ Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben

⁴ Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses

Repo-Overnight-Index (SNB)

Datum	Referenzsatz (gewichtet) ⁵	Tageshöchst	Tagestiefst	Handelsvolumen in Mio. Franken	Anzahl Geschäfte
10.10.05	0.70%	0.75%	0.60%	2'768	43
11.10.05	0.70%	0.75%	0.68%	2'921	51
12.10.05	0.70%	0.77%	0.65%	1'986	35
13.10.05	0.69%	0.74%	0.60%	3'240	49
14.10.05	0.64%	0.70%	0.45%	2'939	46

⁵ Definition siehe www.snb.ch (Aktuelles, Geldpolitisch wichtige Daten)

Tagesergebnisse der geldpolitischen Geschäfte (in Mio. Franken)

Abschluss	SNB ⁶	Kontrakt	von	bis	Art	Preis ⁷	Gebote	Zuteilung
10.10.05	GG	1W	12.10.05	19.10.05	R-Auktion	0.66%	38'731	2'499
11.10.05	GG	1W	13.10.05	20.10.05	R-Auktion	0.66%	48'560	4'500
12.10.05	GG	1W	14.10.05	21.10.05	R-Auktion	0.67%	50'256	6'000

13.10.05	GG	1W	17.10.05	24.10.05	R-Auktion	0.67%	43'158	3'500
14.10.05	GG	1W	18.10.05	25.10.05	R-Auktion	0.67%	50'024	3'001

⁶ GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

⁷ bei bilateralen Geschäften: Durchschnittssatz; bei Swaps: Terminauf- bzw. abschläge (Pips)