

Kommunikation

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

Zürich, 27. Februar 2006

Medienmitteilung

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 24. Februar 2006

Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

| Aktiven (in Mio. Franken) | 24. Februar 2006 | Veränderungen gegenüber Vorwoche |
|--|------------------|----------------------------------|
| Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften | 22'006.0 | +2'004.0 |
| Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazilität | 0.0 | 0.0 |
| Passiven (in Mio. Franken) | | |
| Notenumlauf | 37'788.9 | +254.9 |
| Girokonten inländischer Banken | 6'026.9 | +1'402.6 |
| Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften | 0.0 | 0.0 |

Referenzzinssätze SNB

| Datum | Zielband für Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor | Sondersatz Engpassfinanzierungsfazilität ¹ |
|----------|-------------------------------|------------------|---|
| 20.02.06 | 0.50% - 1.50% | 1.10000% | 2.91% |
| 21.02.06 | 0.50% - 1.50% | 1.10500% | 2.93% |
| 22.02.06 | 0.50% - 1.50% | 1.11000% | 2.88% |
| 23.02.06 | 0.50% - 1.50% | 1.11417% | 2.84% |
| 24.02.06 | 0.50% - 1.50% | 1.13167% | 2.79% |

¹ Repo-Overnight-Index (SNB) vom Vortag + 2%

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

| vergangene Unterlegungsperiode | | laufende Unterlegungsperiode | |
|--------------------------------|--------------|------------------------------|--------------|
| Durchschnitt bis | Giroguthaben | Durchschnitt bis | Giroguthaben |

| | | | |
|------------------------|-------|----------|-------|
| 20.01.06 | 4'197 | 24.02.06 | 5'358 |
| 27.01.06 | 4'502 | | |
| 03.02.06 | 4'547 | | |
| 10.02.06 | 4'609 | | |
| 17.02.06 | 4'615 | | |
| Schlusswert Periode | 4'616 | | |

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 | 7'692 | 9'206 | 4'676 | 4'530 | 120 | 3.73% |
| 20.07.05 - 19.08.05 | 7'648 | 9'122 | 4'632 | 4'490 | 119 | 3.74% |
| 20.08.05 - 19.09.05 | 7'652 | 9'084 | 4'629 | 4'455 | 119 | 3.73% |
| 20.09.05 - 19.10.05 | 7'657 | 9'385 | 4'518 | 4'867 | 123 | 3.74% |
| 20.10.05 - 19.11.05 | 7'763 | 9'201 | 4'517 | 4'683 | 119 | 3.75% |
| 20.11.05 - 19.12.05 | 7'830 | 10'123 | 4'640 | 5'484 | 129 | 3.90% |
| 20.12.05 - 19.01.06 | 7'962 | 9'995 | 5'036 | 4'959 | 126 | 3.90% |

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 |
|----------|--|-------------|-------------|-----------------------------------|---------------------|
| 20.02.06 | 0.93% | 0.97% | 0.87% | 2'951 | 60 |
| 21.02.06 | 0.88% | 0.93% | 0.85% | 2'614 | 47 |
| 22.02.06 | 0.84% | 0.89% | 0.72% | 2'234 | 49 |
| 23.02.06 | 0.79% | 0.90% | 0.70% | 2'548 | 45 |
| 24.02.06 | 0.81% | 0.86% | 0.75% | 3'428 | 53 |

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 |
|-----------|------------------|----------|----------|----------|-----------|--------------------|--------|-----------|
| 20.02.06 | GG | 1W | 22.02.06 | 01.03.06 | R-Auktion | 0.85% | 34'340 | 3'502 |
| 21.02.06 | GG | 1W | 23.02.06 | 02.03.06 | R-Auktion | 0.85% | 45'735 | 4'502 |

| | | | | | | | | |
|----------|----|----|----------|----------|-----------|-------|--------|-------|
| 22.02.06 | GG | 1W | 24.02.06 | 03.03.06 | R-Auktion | 0.86% | 49'520 | 5'500 |
| 23.02.06 | GG | 1W | 27.02.06 | 06.03.06 | R-Auktion | 0.86% | 15'105 | 4'000 |
| 24.02.06 | GG | 1W | 28.02.06 | 07.03.06 | R-Auktion | 0.86% | 24'305 | 4'000 |

⁶ GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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