

## Kommunikation

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

Zürich, 24. Juli 2006

## Medienmitteilung

# Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 21. Juli 2006

### Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

Aktiven (in Mio. Franken)	21. Juli 2006	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuerungsgeschäften	18'260.0	-90.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazilität	0.0	0.0
<b>Passiven (in Mio. Franken)</b>		
Notenumlauf	37'228.8	-416.8
Girokonten inländischer Banken	4'349.2	+268.7
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazilität <sup>1</sup>
17.07.06	1.00% - 2.00%	1.51417%	2.96%
18.07.06	1.00% - 2.00%	1.51917%	3.34%
19.07.06	1.00% - 2.00%	1.52667%	3.45%
20.07.06	1.00% - 2.00%	1.53000%	3.19%
21.07.06	1.00% - 2.00%	1.53000%	3.27%

<sup>1</sup> Repo-Overnight-Index (SNB) vom Vortag + 2%

### Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode (in Mio. Franken) <sup>2</sup>

vergangene Unterlegungsperiode		laufende Unterlegungsperiode	
Durchschnitt bis	Giroguthaben	Durchschnitt bis	Giroguthaben

23.06.06	5'815	21.07.06	4'776
30.06.06	6'137		
07.07.06	5'734		
14.07.06	5'365		
Schlusswert Periode	5'092		

<sup>2</sup> 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 <sup>3</sup>	Noten Münzen	Giro- guthaben	Erfüllungs- grad in %	Zinssatz <sup>4</sup>
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	7'960	9'995	5'036	4'959	126	3.90%
20.01.06 - 19.02.06	8'032	9'451	4'839	4'612	118	3.91%
20.02.06 - 19.03.06	8'055	10'042	4'884	5'157	125	4.03%
20.03.06 - 19.04.06	8'155	9'795	4'937	4'859	120	4.16%
20.04.06 - 19.05.06	8'225	10'023	4'724	5'300	122	4.27%

<sup>3</sup> Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben

<sup>4</sup> Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses

#### Repo-Overnight-Index (SNB)

Datum	Referenzsatz (gewichtet) <sup>5</sup>	Tageshöchst	Tagestiefst	Handelsvolumen in Mio. Franken	Anzahl Geschäfte
17.07.06	1.34%	1.45%	1.27%	3'041	63
18.07.06	1.45%	1.70%	1.25%	2'803	59
19.07.06	1.19%	1.40%	0.50%	3'013	56
20.07.06	1.27%	1.32%	1.20%	3'520	58
21.07.06	1.33%	1.37%	1.28%	3'527	62

<sup>5</sup> Definition siehe [www.snb.ch](http://www.snb.ch) (Aktuelles, Geldpolitisch wichtige Daten)

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

Abschluss	SNB <sup>6</sup>	Kontrakt	von	bis	Art	Preis <sup>7</sup>	Gebote	Zuteilung
17.07.06	GG	1W	19.07.06	26.07.06	R-Auktion	1.32%	9'415	5'000
18.07.06	GG	1W	20.07.06	27.07.06	R-Auktion	1.33%	7'750	4'500
18.07.06	GG	ON	18.07.06	19.07.06	R-Bilateral	1.58%	1'235	1'235

19.07.06	GG	1W	21.07.06	28.07.06	R-Auktion	1.33%	11'850	4'000
20.07.06	GG	1W	24.07.06	31.07.06	R-Auktion	1.33%	11'313	3'001
21.07.06	GG	2W	25.07.06	08.08.06	R-Auktion	1.34%	10'785	3'001

---

<sup>6</sup> GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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