

## Kommunikation

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

Zürich, 4. September 2006

## Medienmitteilung

# Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 1. September 2006

### Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

Aktiven (in Mio. Franken)	1. September 2006	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	20'102.0	+700.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
<b>Passiven (in Mio. Franken)</b>		
Notenumlauf	37'889.0	+753.8
Girokonten inländischer Banken	4'741.8	-222.6
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität <sup>1</sup>
28.08.06	1.00% - 2.00%	-	3.37%
29.08.06	1.00% - 2.00%	1.66000%	3.36%
30.08.06	1.00% - 2.00%	1.67000%	3.36%
31.08.06	1.00% - 2.00%	1.68000%	3.35%
01.09.06	1.00% - 2.00%	1.68083%	3.37%

<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

21.07.06	4'776	25.08.06	4'910
28.07.06	4'634	01.09.06	4'852
04.08.06	4'535		
11.08.06	4'682		
18.08.06	4'746		
Schlusswert Periode	4'749		

<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>
20.07.05 - 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%
20.05.06 - 19.06.06	8'285	10'473	4'845	5'627	126	4.34%
20.06.06 - 19.07.06	8'241	9'822	4'737	5'085	119	4.42%

<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
28.08.06	1.36%	1.42%	1.30%	3'475	67
29.08.06	1.36%	1.39%	1.33%	2'673	59
30.08.06	1.35%	1.38%	1.32%	2'693	53
31.08.06	1.37%	1.40%	1.35%	3'539	56
01.09.06	1.38%	1.43%	1.33%	4'830	81

<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
28.08.06	GG	1W	30.08.06	06.09.06	R-Auktion	1.37%	12'389	3'001
29.08.06	GG	1W	31.08.06	07.09.06	R-Auktion	1.37%	11'177	4'201

30.08.06	GG	1W	01.09.06	08.09.06	R-Auktion	1.37%	12'862	5'200
31.08.06	GG	1W	04.09.06	11.09.06	R-Auktion	1.37%	18'860	4'200
01.09.06	GG	1W	05.09.06	12.09.06	R-Auktion	1.37%	23'625	3'301

---

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

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