

Kommunikation

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

Zürich, 11. September 2006

Medienmitteilung

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 8. September 2006

Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

| Aktiven (in Mio. Franken) | 8. September 2006 | Veränderungen gegenüber Vorwoche |
|--|-------------------|----------------------------------|
| Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften | 19'703.0 | -399.0 |
| Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität | 0.0 | 0.0 |
| Passiven (in Mio. Franken) | | |
| Notenumlauf | 37'376.0 | -513.0 |
| Girokonten inländischer Banken | 5'028.2 | +286.4 |
| Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften | 0.0 | 0.0 |

Referenzzinssätze SNB

| Datum | Zielband für Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor | Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität ¹ |
|----------|-------------------------------|------------------|---|
| 04.09.06 | 1.00% - 2.00% | 1.68000% | 3.38% |
| 05.09.06 | 1.00% - 2.00% | 1.69000% | 3.36% |
| 06.09.06 | 1.00% - 2.00% | 1.69417% | 3.39% |
| 07.09.06 | 1.00% - 2.00% | 1.70083% | 3.37% |
| 08.09.06 | 1.00% - 2.00% | 1.70750% | 3.33% |

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

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

| 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 | 08.09.06 | 4'839 |
| 11.08.06 | 4'682 | | |
| 18.08.06 | 4'746 | | |
| Schlusswert Periode | 4'749 | | |

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 |
|---------------------|-------------|--------------------------------------|-----------------|-------------------|--------------------------|-----------------------|
| 20.07.05 - 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% |

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 |
|----------|--|-------------|-------------|-----------------------------------|---------------------|
| 04.09.06 | 1.36% | 1.39% | 1.33% | 3'766 | 64 |
| 05.09.06 | 1.39% | 1.50% | 1.34% | 3'991 | 62 |
| 06.09.06 | 1.37% | 1.42% | 1.30% | 3'112 | 59 |
| 07.09.06 | 1.33% | 1.37% | 1.30% | 2'818 | 51 |
| 08.09.06 | 1.29% | 1.32% | 1.22% | 2'456 | 52 |

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 |
|-----------|------------------|----------|----------|----------|-----------|--------------------|--------|-----------|
| 04.09.06 | GG | 1W | 06.09.06 | 13.09.06 | R-Auktion | 1.37% | 23'795 | 3'001 |
| 05.09.06 | GG | 1W | 07.09.06 | 14.09.06 | R-Auktion | 1.38% | 12'850 | 4'201 |

| | | | | | | | | |
|----------|----|----|----------|----------|-----------|-------|--------|-------|
| 06.09.06 | GG | 1W | 08.09.06 | 15.09.06 | R-Auktion | 1.38% | 10'832 | 5'000 |
| 07.09.06 | GG | 1W | 11.09.06 | 18.09.06 | R-Auktion | 1.38% | 6'580 | 4'000 |
| 08.09.06 | GG | 1W | 12.09.06 | 19.09.06 | R-Auktion | 1.39% | 3'821 | 3'000 |

⁶ GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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