

## Kommunikation

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

Zürich, 18. September 2006

## Medienmitteilung

# Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 15. September 2006

### Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

Aktiven (in Mio. Franken)	15. September 2006	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	19'103.0	-600.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazilität	0.0	0.0
<b>Passiven (in Mio. Franken)</b>		
Notenumlauf	37'011.6	-364.4
Girokonten inländischer Banken	4'872.0	-156.2
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazilität <sup>1</sup>
11.09.06	1.00% - 2.00%	1.71167%	3.29%
12.09.06	1.00% - 2.00%	1.71667%	3.34%
13.09.06	1.00% - 2.00%	1.71000%	3.36%
14.09.06	1.25% - 2.25%	1.72333%	3.36%
15.09.06	1.25% - 2.25%	1.75000%	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	08.09.06	4'839
11.08.06	4'682	15.09.06	4'830
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
11.09.06	1.34%	1.40%	1.30%	3'931	67
12.09.06	1.36%	1.42%	1.30%	2'557	49
13.09.06	1.36%	1.39%	1.33%	3'585	55
14.09.06	1.37%	1.45%	1.35%	3'021	60
15.09.06	1.51%	1.57%	1.39%	4'725	79

<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
11.09.06	GG	1W	13.09.06	20.09.06	R-Auktion	1.39%	18'256	2'900
12.09.06	GG	1W	14.09.06	21.09.06	R-Auktion	1.39%	22'059	4'203

13.09.06	GG	1W	15.09.06	22.09.06	R-Auktion	1.39%	27'040	5'000
14.09.06	GG	1W	18.09.06	25.09.06	R-Auktion	1.39%	97'753	4'001
15.09.06	GG	1W	19.09.06	26.09.06	R-Auktion	1.62%	12'673	3'000

---

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

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