

Kommunikation

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

Zürich, 2. Oktober 2006

Medienmitteilung

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 29. September 2006

Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

Aktiven (in Mio. Franken)	29. September 2006	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	21'002.0	+2'098.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	-55.0
Passiven (in Mio. Franken)		
Notenumlauf	38'134.3	+1'022.6
Girokonten inländischer Banken	5'748.7	+1'179.2
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität ¹
25.09.06	1.25% - 2.25%	1.76000%	3.61%
26.09.06	1.25% - 2.25%	1.76000%	3.62%
27.09.06	1.25% - 2.25%	1.77500%	3.61%
28.09.06	1.25% - 2.25%	1.81000%	3.63%
29.09.06	1.25% - 2.25%	1.81083%	3.65%

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

25.08.06	4'910	22.09.06	4'502
01.09.06	4'852	29.09.06	4'745
08.09.06	4'839		
15.09.06	4'830		
Schlusswert Periode	4'837		

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
20.08.05 - 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%
20.07.06 - 19.08.06	8'180	9'565	4'818	4'747	117	4.43%

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
25.09.06	1.62%	1.69%	1.58%	5'383	86
26.09.06	1.61%	1.65%	1.58%	3'983	67
27.09.06	1.63%	1.75%	1.58%	3'016	62
28.09.06	1.65%	1.72%	1.60%	5'836	89
29.09.06	1.67%	1.75%	1.60%	3'883	70

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
25.09.06	GG	1W	27.09.06	04.10.06	R-Auktion	1.62%	16'538	2'801
26.09.06	GG	1W	28.09.06	05.10.06	R-Auktion	1.62%	25'617	4'501
27.09.06	GG	1W	29.09.06	06.10.06	R-Auktion	1.62%	28'488	6'200

28.09.06	GG	1W	02.10.06	09.10.06	R-Auktion	1.63%	12'028	3'801
29.09.06	GG	1W	03.10.06	10.10.06	R-Auktion	1.63%	17'061	3'000

⁶ GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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