

Kommunikation

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

Zürich, 23. Oktober 2006

Medienmitteilung

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 20. Oktober 2006

Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

Aktiven (in Mio. Franken)	20. Oktober 2006	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	17'802.0	-1'600.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazilität	0.0	0.0
Passiven (in Mio. Franken)		
Notenumlauf	37'033.1	-458.6
Girokonten inländischer Banken	3'844.7	-1'191.8
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazilität ¹
16.10.06	1.25% - 2.25%	1.84750%	3.50%
17.10.06	1.25% - 2.25%	1.84667%	3.51%
18.10.06	1.25% - 2.25%	1.85000%	3.52%
19.10.06	1.25% - 2.25%	1.85917%	3.51%
20.10.06	1.25% - 2.25%	1.86000%	3.32%

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

22.09.06	4'502	20.10.06	3'845
29.09.06	4'745		
06.10.06	4'962		
13.10.06	4'999		
Schlusswert Periode	4'959		

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
16.10.06	1.51%	1.60%	1.40%	3'766	70
17.10.06	1.52%	1.63%	1.47%	3'035	63
18.10.06	1.51%	1.60%	1.40%	3'133	62
19.10.06	1.32%	1.50%	0.10%	2'448	51
20.10.06	1.64%	1.70%	1.60%	3'424	60

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
16.10.06	GG	1W	18.10.06	25.10.06	R-Auktion	1.63%	15'512	3'000
17.10.06	GG	1W	19.10.06	26.10.06	R-Auktion	1.63%	15'630	4'001
18.10.06	GG	1W	20.10.06	27.10.06	R-Auktion	1.63%	19'675	5'000

19.10.06	GG	1W	23.10.06	30.10.06	R-Auktion	1.63%	19'730	4'200
20.10.06	GG	1W	24.10.06	31.10.06	R-Auktion	1.63%	10'987	3'501

⁶ GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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