

## Kommunikation

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

Zürich, 8. Januar 2007

## Medienmitteilung

# Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 5. Januar 2007

### Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

Aktiven (in Mio. Franken)	5. Januar 2007	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuerungsgeschäften	26'748.0	-356.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	-13.0
<b>Passiven (in Mio. Franken)</b>		
Notenumlauf	42'231.7	-950.5
Girokonten inländischer Banken	7'206.9	+490.9
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität <sup>1</sup>
01.01.07	1.50% - 2.50%	-	-
02.01.07	1.50% - 2.50%	2.11083%	-
03.01.07	1.50% - 2.50%	2.12000%	3.88%
04.01.07	1.50% - 2.50%	2.13750%	3.99%
05.01.07	1.50% - 2.50%	2.14333%	4.04%

<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

24.11.06	5'076	22.12.06	5'444
01.12.06	5'246	29.12.06	5'532
08.12.06	5'569	05.01.07	5'814
15.12.06	5'145		
Schlusswert Periode	5'087		

<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>
20.11.05 - 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%
20.08.06 - 19.09.06	8'142	9'479	4'644	4'834	116	4.57%
20.09.06 - 19.10.06	8'119	9'765	4'810	4'956	120	4.73%
20.10.06 - 19.11.06	8'184	9'464	4'643	4'821	116	4.74%

<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
01.01.07	-	-	-	-	-
02.01.07	-	-	-	-	-
03.01.07	1.99%	2.07%	1.92%	3'374	71
04.01.07	2.04%	2.15%	1.97%	2'965	69
05.01.07	1.93%	2.15%	1.70%	3'536	73

<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
01.01.07	-	-	-	-	-	-	-	-
02.01.07	-	-	-	-	-	-	-	-
03.01.07	GG	1W	05.01.07	12.01.07	R-Auktion	1.90%	21'110	4'801

04.01.07	GG	1W	08.01.07	15.01.07	R-Auktion	1.90%	29'514	5'500
04.01.07	GG	ON	04.01.07	05.01.07	R-Auktion	2.03%	1'375	1'375
04.01.07	GG	TN	05.01.07	08.01.07	R-Bilateral	2.03%	2'000	2'000
05.01.07	GG	1W	09.01.07	16.01.07	R-Auktion	1.90%	49'645	4'000
05.01.07	GG	ON	05.01.07	08.01.07	R-Bilateral	2.01%	1'442	1'442

---

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

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