

Kommunikation

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

Zürich, 22. Januar 2007

Medienmitteilung

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 19. Januar 2007

Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

Aktiven (in Mio. Franken)	19. Januar 2007	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuerungsgeschäften	19'883.0	-1'118.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
Passiven (in Mio. Franken)		
Notenumlauf	38'845.8	-1'130.4
Girokonten inländischer Banken	3'658.7	-8.5
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität ¹
15.01.07	1.50% - 2.50%	2.14917%	3.71%
16.01.07	1.50% - 2.50%	2.14917%	3.44%
17.01.07	1.50% - 2.50%	2.14833%	3.66%
18.01.07	1.50% - 2.50%	2.15667%	3.93%
19.01.07	1.50% - 2.50%	2.15500%	3.85%

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	Giro Guthaben	Durchschnitt bis	Giro Guthaben

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	12.01.07	5'610
		19.01.07	5'200
Schlusswert Periode	5'087		

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
20.11.05 - 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%

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
15.01.07	1.44%	1.95%	1.00%	4'367	89
16.01.07	1.66%	1.90%	1.25%	4'350	74
17.01.07	1.93%	2.00%	1.75%	4'602	87
18.01.07	1.85%	1.95%	1.50%	3'107	64
19.01.07	1.69%	1.87%	1.00%	2'611	61

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
15.01.07	GN	ON	15.01.07	16.01.07	R-Bilateral	1.33%	220	220
15.01.07	GG	1W	17.01.07	24.01.07	R-Auktion	1.90%	37'545	3'181

15.01.07	GG	SN	17.01.07	18.01.07	R-Auktion	1.89%	1'820	1'820
16.01.07	GG	1W	18.01.07	25.01.07	R-Auktion	1.90%	30'369	3'001
17.01.07	GG	1W	19.01.07	26.01.07	R-Auktion	1.90%	38'725	4'200
18.01.07	GG	1W	22.01.07	29.01.07	R-Auktion	1.90%	27'230	5'000
18.01.07	GG	Non-Std	22.01.07	25.01.07	R-Auktion	1.90%	10'060	1'800
19.01.07	GG	1W	23.01.07	30.01.07	R-Auktion	1.90%	38'226	4'001

⁶ GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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