

Kommunikation

Postfach, CH-8022 Zürich
Telefon +41 1 631 31 11
Telefax +41 1 631 39 10
www.snb.ch
snb@.snb.ch

Zürich, 17. Mai 2004

Medienmitteilung

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 14. Mai 2004

Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

| AKTIVEN (in Mio. Franken) | 14.05.2004 | Veränderungen gegenüber Vorwoche |
|---|------------|-------------------------------------|
| Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuerungsgeschäften | 18'698.0 | -1'000.0 |
| Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität | 0.0 | +0.0 |
| PASSIVEN (in Mio. Franken) | | |
| Notenumlauf | 35'707.7 | -275.9 |
| Girokonten inländischer Banken | 5'755.6 | -1'260.5 |
| Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften | 0.0 | +0.0 |

Referenzzinssätze SNB

| Datum | Zielband für Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor | Sondersatz Engpassfinanzierung ¹ |
|----------|----------------------------------|------------------|--|
| 10.05.04 | 0.00% - 0.75% | 0.28833% | 2.09% |
| 11.05.04 | 0.00% - 0.75% | 0.28833% | 2.13% |
| 12.05.04 | 0.00% - 0.75% | 0.27000% | 2.10% |
| 13.05.04 | 0.00% - 0.75% | 0.27000% | 2.07% |
| 14.05.04 | 0.00% - 0.75% | 0.27750% | 2.07% |

¹ Repo-Overnight-Index (SNB) vom Vortag + 2%

Repo-Overnight-Index (SNB)

| Datum | Referenzzinssatz (gewichtet) ² | Tageshöchst | Tagestiefst | Handelsvolumen in Mio. Franken | Anzahl Geschäfte |
|----------|--|-------------|-------------|-----------------------------------|---------------------|
| 10.05.04 | 0.13% | 0.15% | 0.10% | 2'381 | 38 |

| | | | | | |
|----------|-------|-------|-------|-------|----|
| 11.05.04 | 0.10% | 0.13% | 0.07% | 1'647 | 29 |
| 12.05.04 | 0.07% | 0.10% | 0.05% | 1'918 | 37 |
| 13.05.04 | 0.07% | 0.10% | 0.05% | 1'781 | 28 |
| 14.05.04 | 0.10% | 0.12% | 0.06% | 3'618 | 55 |

² Definition siehe www.snb.ch (Aktuelles, Geldpolitisch wichtige Daten)

Tagesergebnisse der geldpolitischen Geschäfte (in Mio. Franken)

| Abschluss | SNB ³ | Kontrakt | von | bis | Art | Preis ⁴ | Gebote | Zuteilung |
|-----------|------------------|----------|----------|----------|-----------|--------------------|--------|-----------|
| 10.05.04 | GG | 1W | 12.05.04 | 19.05.04 | R-Auktion | 0.11% | 39'595 | 3'000 |
| 11.05.04 | GG | 2W | 13.05.04 | 27.05.04 | R-Auktion | 0.11% | 40'629 | 5'499 |
| 12.05.04 | GG | 1W | 14.05.04 | 21.05.04 | R-Auktion | 0.11% | 15'498 | 5'000 |
| 13.05.04 | GG | 1W | 17.05.04 | 24.05.04 | R-Auktion | 0.11% | 11'511 | 2'499 |
| 14.05.04 | GG | 1W | 18.05.04 | 25.05.04 | R-Auktion | 0.11% | 19'536 | 2'499 |

³ GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

⁴ bei bilateralen Geschäften: Durchschnittssatz; bei Swaps: Terminaufschläge bzw. -abschläge (Pips)