

Kommunikation

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

Zürich, 20. September 2004

Medienmitteilung

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 17. September 2004

Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

Aktiven (in Mio. Franken)	17. September 2004	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	25'996.0	+552.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
Passiven (in Mio. Franken)		
Notenumlauf	35'180.2	-344.3
Girokonten inländischer Banken	5'139.9	+44.4
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität ¹
13.09.04	0.00% - 1.00%	0.66083%	2.16%
14.09.04	0.00% - 1.00%	0.66667%	2.11%
15.09.04	0.00% - 1.00%	0.67333%	2.21%
16.09.04	0.25% - 1.25%	0.68500%	2.21%
17.09.04	0.25% - 1.25%	0.67667%	2.14%

¹ Repo-Overnight-Index (SNB) vom Vortag + 2%
Der Lombardsatz entspricht bis Ende 2005 dem Sondersatz.

Repo-Overnight-Index (SNB)

Datum	Referenzzinssatz (gewichtet) ²	Tageshöchst	Tagestiefst	Handelsvolumen in Mio. Franken	Anzahl Geschäfte
13.09.04	0.11%	0.15%	0.06%	1'559	24

14.09.04	0.21%	0.25%	0.15%	3'457	55
15.09.04	0.21%	0.25%	0.13%	5'501	71
16.09.04	0.14%	0.20%	0.05%	2'014	32
17.09.04	0.09%	0.16%	0.03%	1'807	31

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
13.09.04	GG	1W	15.09.04	22.09.04	R-Auktion	0.27%	36'403	2'998
14.09.04	GG	1W	16.09.04	23.09.04	R-Auktion	0.28%	56'781	2'997
15.09.04	GG	1W	17.09.04	24.09.04	R-Auktion	0.29%	68'215	6'000
16.09.04	GG	1W	20.09.04	27.09.04	R-Auktion	0.30%	68'570	4'999
17.09.04	GG	1W	21.09.04	28.09.04	R-Auktion	0.43%	18'480	5'201
17.09.04	GG	3W	21.09.04	12.10.04	R-Auktion	0.46%	16'105	5'202

³ GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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