

Kommunikation

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

Zürich, 13. Dezember 2004

Medienmitteilung

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 10. Dezember 2004

Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

| Aktiven (in Mio. Franken) | 10. Dezember 2004 | Veränderungen gegenüber Vorwoche |
|---|-------------------|-------------------------------------|
| Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften | 20'501.0 | +743.0 |
| Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität | 0.0 | 0.0 |
| Passiven (in Mio. Franken) | | |
| Notenumlauf | 37'252.1 | -73.0 |
| Girokonten inländischer Banken | 4'924.5 | +584.4 |
| Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften | 0.0 | 0.0 |

Referenzzinssätze SNB

| Datum | Zielband für Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor | Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität ¹ |
|----------|----------------------------------|------------------|--|
| 06.12.04 | 0.25% - 1.25% | 0.76000% | 2.56% |
| 07.12.04 | 0.25% - 1.25% | 0.75000% | 2.42% |
| 08.12.04 | 0.25% - 1.25% | 0.75667% | 2.45% |
| 09.12.04 | 0.25% - 1.25% | 0.75833% | 2.48% |
| 10.12.04 | 0.25% - 1.25% | 0.77000% | 2.53% |

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 |
|----------|--|-------------|-------------|-----------------------------------|---------------------|
| 06.12.04 | 0.42% | 0.50% | 0.20% | 2'527 | 37 |

| | | | | | |
|----------|-------|-------|-------|-------|----|
| 07.12.04 | 0.45% | 0.51% | 0.40% | 2'652 | 43 |
| 08.12.04 | 0.48% | 0.50% | 0.45% | 2'716 | 41 |
| 09.12.04 | 0.53% | 0.60% | 0.47% | 1'571 | 30 |
| 10.12.04 | 0.67% | 0.90% | 0.60% | 1'870 | 40 |

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 |
|-----------|------------------|----------|----------|----------|-----------|--------------------|--------|-----------|
| 06.12.04 | GG | 1W | 08.12.04 | 15.12.04 | R-Auktion | 0.50% | 31'843 | 5'500 |
| 07.12.04 | GG | 1W | 09.12.04 | 16.12.04 | R-Auktion | 0.50% | 16'100 | 4'500 |
| 08.12.04 | GG | 1W | 10.12.04 | 17.12.04 | R-Auktion | 0.50% | 16'500 | 2'501 |
| 09.12.04 | GG | 1W | 13.12.04 | 20.12.04 | R-Auktion | 0.50% | 36'205 | 5'000 |
| 10.12.04 | GG | 1W | 14.12.04 | 21.12.04 | R-Auktion | 0.52% | 53'800 | 4'000 |

³ GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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