

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. August 2005

Medienmitteilung

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 19. August 2005

Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

| Aktiven (in Mio. Franken) | 19. August 2005 | Veränderungen gegenüber Vorwoche |
|---|-----------------|-------------------------------------|
| Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften | 18'438.0 | +132.0 |
| Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität | 0.7 | +0.7 |
| Passiven (in Mio. Franken) | | |
| Notenumlauf | 36'111.0 | -284.7 |
| Girokonten inländischer Banken | 4'634.1 | +363.0 |
| Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften | 0.0 | 0.0 |

Referenzzinssätze SNB

| Datum | Zielband für Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor | Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität ¹ |
|----------|----------------------------------|------------------|--|
| 15.08.05 | 0.25% - 1.25% | 0.75500% | 2.52% |
| 16.08.05 | 0.25% - 1.25% | 0.75833% | 2.65% |
| 17.08.05 | 0.25% - 1.25% | 0.76000% | 2.65% |
| 18.08.05 | 0.25% - 1.25% | 0.76000% | 2.64% |
| 19.08.05 | 0.25% - 1.25% | 0.76000% | 2.63% |

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

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode (in Mio. Franken) ²

| vergangene Unterlegungsperiode | | laufende Unterlegungsperiode | |
|--------------------------------|--------------|------------------------------|--------------|
| Durchschnitt bis | Giroguthaben | Durchschnitt bis | Giroguthaben |

| | | | |
|------------------------|-------|----------|-------|
| 24.06.05 | 4'845 | 22.07.05 | 4'444 |
| 01.07.05 | 4'887 | 29.07.05 | 4'362 |
| 08.07.05 | 4'692 | 05.08.05 | 4'457 |
| 15.07.05 | 4'570 | 12.08.05 | 4'557 |
| | | 19.08.05 | 4'488 |
| Schlusswert Periode | 4'529 | | |

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 |
|---------------------|-------------|--------------------------------------|-----------------|-------------------|--------------------------|-----------------------|
| - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - |
| 20.01.05 - 19.02.05 | 7'343 | 9'343 | 4'462 | 4'881 | 127 | 3.72% |
| 20.02.05 - 19.03.05 | 7'431 | 9'260 | 4'494 | 4'766 | 125 | 3.72% |
| 20.03.05 - 19.04.05 | 7'504 | 9'378 | 4'606 | 4'771 | 125 | 3.74% |
| 20.04.05 - 19.05.05 | 7'627 | 9'548 | 4'599 | 4'949 | 125 | 3.74% |
| 20.05.05 - 19.06.05 | 7'666 | 9'158 | 4'569 | 4'589 | 119 | 3.73% |

³ Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben

⁴ Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses

Repo-Overnight-Index (SNB)

| Datum | Referenzsatz (gewichtet) ⁴ | Tageshöchst | Tagestiefst | Handelsvolumen in Mio. Franken | Anzahl Geschäfte |
|----------|--|-------------|-------------|-----------------------------------|---------------------|
| 15.08.05 | 0.65% | 0.75% | 0.56% | 4'163 | 65 |
| 16.08.05 | 0.65% | 0.78% | 0.62% | 3'055 | 54 |
| 17.08.05 | 0.64% | 0.72% | 0.58% | 2'707 | 46 |
| 18.08.05 | 0.63% | 0.67% | 0.60% | 2'983 | 56 |
| 19.08.05 | 0.55% | 0.65% | 0.35% | 1'349 | 30 |

⁴ Definition siehe www.snb.ch (Aktuelles, Geldpolitisch wichtige Daten)

Tagesergebnisse der geldpolitischen Geschäfte (in Mio. Franken)

| Abschluss | SNB ⁵ | Kontrakt | von | bis | Art | Preis ⁶ | Gebote | Zuteilung |
|-----------|------------------|----------|----------|----------|-----------|--------------------|--------|-----------|
| 15.08.05 | GG | 1W | 17.08.05 | 24.08.05 | R-Auktion | 0.65% | 10'060 | 3'000 |
| 16.08.05 | GG | 1W | 18.08.05 | 25.08.05 | R-Auktion | 0.65% | 30'460 | 5'000 |

| | | | | | | | | |
|----------|----|----|----------|----------|-----------|-------|--------|-------|
| 17.08.05 | GG | 1W | 19.08.05 | 26.08.05 | R-Auktion | 0.65% | 27'660 | 3'301 |
| 18.08.05 | GG | 1W | 22.08.05 | 29.08.05 | R-Auktion | 0.65% | 49'427 | 3'600 |
| 19.08.05 | GG | 1W | 23.08.05 | 30.08.05 | R-Auktion | 0.65% | 50'522 | 3'700 |

⁵ GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

⁶ bei bilateralen Geschäften: Durchschnittssatz; bei Swaps: Terminauf- bzw. abschläge (Pips)