

Kommunikation

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

Zürich, 10. Oktober 2005

Medienmitteilung

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 7. Oktober 2005

Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

Aktiven (in Mio. Franken)	7. Oktober 2005	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuerungsgeschäften	20'300.0	-1'704.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
Passiven (in Mio. Franken)		
Notenumlauf	36'860.1	-334.7
Girokonten inländischer Banken	5'813.3	+28.6
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität ¹
03.10.05	0.25% - 1.25%	0.79833%	2.68%
04.10.05	0.25% - 1.25%	0.80708%	2.68%
05.10.05	0.25% - 1.25%	0.81000%	2.71%
06.10.05	0.25% - 1.25%	0.80833%	2.74%
07.10.05	0.25% - 1.25%	0.80000%	2.70%

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

26.08.05	4'515	23.09.05	4'734
02.09.05	4'539	30.09.05	4'681
09.09.05	4'544	07.10.05	4'813
16.09.05	4'499		
Schlusswert Periode	4'457		

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%
20.06.05 - 19.07.05	7'682	9'206	4'676	4'530	120	3.73%
20.07.05 - 19.08.05	7'616	9'122	4'632	4'490	120	3.74%

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
03.10.05	0.68%	0.69%	0.65%	2'377	49
04.10.05	0.71%	0.75%	0.68%	2'687	48
05.10.05	0.74%	0.80%	0.65%	2'627	56
06.10.05	0.70%	0.74%	0.67%	2'721	55
07.10.05	0.69%	0.73%	0.68%	3'038	51

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
03.10.05	GG	1W	05.10.05	12.10.05	R-Auktion	0.66%	31'389	2'000
04.10.05	GG	1W	06.10.05	13.10.05	R-Auktion	0.66%	57'336	4'700
05.10.05	GG	1W	07.10.05	14.10.05	R-Auktion	0.66%	50'980	5'500

06.10.05	GG	1W	10.10.05	17.10.05	R-Auktion	0.66%	50'066	3'501
07.10.05	GG	1W	11.10.05	18.10.05	R-Auktion	0.66%	43'220	3'300

⁶ GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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