

## Kommunikation

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

Zürich, 24. Oktober 2005

## Medienmitteilung

# Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 21. Oktober 2005

### Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

Aktiven (in Mio. Franken)	21. Oktober 2005	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	19'503.0	-297.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazilität	0.0	0.0
<b>Passiven (in Mio. Franken)</b>		
Notenumlauf	36'241.6	-97.3
Girokonten inländischer Banken	4'211.0	-823.7
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazilität <sup>1</sup>
17.10.05	0.25% - 1.25%	0.80000%	2.64%
18.10.05	0.25% - 1.25%	0.80000%	2.57%
19.10.05	0.25% - 1.25%	0.80000%	2.35%
20.10.05	0.25% - 1.25%	0.80000%	2.26%
21.10.05	0.25% - 1.25%	0.82000%	2.64%

<sup>1</sup> 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) <sup>2</sup>

vergangene Unterlegungsperiode		laufende Unterlegungsperiode	
Durchschnitt bis	Giroguthaben	Durchschnitt bis	Giroguthaben

23.09.05	4'734	21.10.05	4'245
30.09.05	4'681		
07.10.05	4'813		
14.10.05	4'877		
Schlusswert Periode	4'873		

<sup>2</sup> 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 <sup>3</sup>	Noten Münzen	Giro- guthaben	Erfüllungs- grad in %	Zinssatz <sup>4</sup>
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
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%

<sup>3</sup> Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben

<sup>4</sup> Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses

#### Repo-Overnight-Index (SNB)

Datum	Referenzsatz (gewichtet) <sup>5</sup>	Tageshöchst	Tagestiefst	Handelsvolumen in Mio. Franken	Anzahl Geschäfte
17.10.05	0.57%	0.67%	0.50%	2'292	42
18.10.05	0.35%	0.60%	0.20%	2'962	46
19.10.05	0.26%	0.35%	0.20%	2'891	44
20.10.05	0.64%	0.70%	0.60%	2'622	48
21.10.05	0.64%	0.68%	0.60%	4'222	63

<sup>5</sup> Definition siehe [www.snb.ch](http://www.snb.ch) (Aktuelles, Geldpolitisch wichtige Daten)

#### Tagesergebnisse der geldpolitischen Geschäfte (in Mio. Franken)

Abschluss	SNB <sup>6</sup>	Kontrakt	von	bis	Art	Preis <sup>7</sup>	Gebote	Zuteilung
17.10.05	GG	1W	19.10.05	26.10.05	R-Auktion	0.65%	53'648	2'500
18.10.05	GG	1W	20.10.05	27.10.05	R-Auktion	0.65%	54'928	4'500
19.10.05	GG	1W	21.10.05	28.10.05	R-Auktion	0.65%	44'646	6'002

20.10.05	GG	1W	24.10.05	31.10.05	R-Auktion	0.65%	39'271	4'001
21.10.05	GG	1W	25.10.05	01.11.05	R-Auktion	0.65%	46'135	4'000

---

<sup>6</sup> GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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