

Kommunikation

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

Zürich, 23. Januar 2006

Medienmitteilung

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 20. Januar 2006

Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

Aktiven (in Mio. Franken)	20. Januar 2006	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuerungsgeschäften	20'182.0	-649.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
Passiven (in Mio. Franken)		
Notenumlauf	37'900.9	-837.9
Girokonten inländischer Banken	4'196.8	+324.3
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität ¹
16.01.06	0.50% - 1.50%	1.00083%	2.73%
17.01.06	0.50% - 1.50%	0.99167%	2.71%
18.01.06	0.50% - 1.50%	0.99417%	2.70%
19.01.06	0.50% - 1.50%	0.99583%	2.74%
20.01.06	0.50% - 1.50%	0.99417%	2.76%

¹ Repo-Overnight-Index (SNB) vom Vortag + 2%

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

vergangene Unterlegungsperiode		laufende Unterlegungsperiode	
Durchschnitt bis	Giroguthaben	Durchschnitt bis	Giroguthaben

23.12.05	5'346	20.01.06	4'197
30.12.05	5'529		
06.01.06	5'269		
13.01.06	5'246		
Schlusswert Periode	4'963		

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	7'692	9'206	4'676	4'530	120	3.73%
20.07.05 - 19.08.05	7'648	9'122	4'632	4'490	119	3.74%
20.08.05 - 19.09.05	7'652	9'084	4'629	4'455	119	3.73%
20.09.05 - 19.10.05	7'657	9'385	4'518	4'867	123	3.74%
20.10.05 - 19.11.05	7'763	9'201	4'517	4'683	119	3.75%

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
16.01.06	0.71%	0.75%	0.60%	7'237	93
17.01.06	0.70%	0.75%	0.55%	5'136	78
18.01.06	0.74%	0.77%	0.67%	5'584	82
19.01.06	0.76%	0.78%	0.72%	3'569	62
20.01.06	0.78%	0.83%	0.72%	2'553	46

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
16.01.06	GG	1W	18.01.06	25.01.06	R-Auktion	0.75%	22'621	4'001
17.01.06	GG	1W	19.01.06	26.01.06	R-Auktion	0.75%	4'678	4'678
18.01.06	GG	1W	20.01.06	27.01.06	R-Auktion	0.77%	12'508	6'002

19.01.06	GG	1W	23.01.06	30.01.06	R-Auktion	0.78%	16'345	3'000
20.01.06	GG	1W	24.01.06	31.01.06	R-Auktion	0.78%	17'670	3'300

⁶ GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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