

Kommunikation

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

Zürich, 31. Juli 2006

Medienmitteilung

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 28. Juli 2006

Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

Aktiven (in Mio. Franken)	28. Juli 2006	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuerungsgeschäften	19'002.0	+742.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
Passiven (in Mio. Franken)		
Notenumlauf	38'074.9	+846.1
Girokonten inländischer Banken	4'303.9	-45.3
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität ¹
24.07.06	1.00% - 2.00%	1.53583%	3.33%
25.07.06	1.00% - 2.00%	1.54000%	3.32%
26.07.06	1.00% - 2.00%	1.54000%	3.28%
27.07.06	1.00% - 2.00%	1.54000%	3.28%
28.07.06	1.00% - 2.00%	1.55000%	3.30%

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

23.06.06	5'815	21.07.06	4'776
30.06.06	6'137	28.07.06	4'634
07.07.06	5'734		
14.07.06	5'365		
Schlusswert Periode	5'092		

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
20.06.05 - 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%
20.11.05 - 19.12.05	7'830	10'123	4'640	5'484	129	3.90%
20.12.05 - 19.01.06	7'960	9'995	5'036	4'959	126	3.90%
20.01.06 - 19.02.06	8'032	9'451	4'839	4'612	118	3.91%
20.02.06 - 19.03.06	8'055	10'042	4'884	5'157	125	4.03%
20.03.06 - 19.04.06	8'155	9'795	4'937	4'859	120	4.16%
20.04.06 - 19.05.06	8'225	10'023	4'724	5'300	122	4.27%
20.05.06 - 19.06.06	8'285	10'473	4'845	5'627	126	4.34%

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
24.07.06	1.32%	1.36%	1.25%	4'182	68
25.07.06	1.28%	1.35%	1.20%	3'799	65
26.07.06	1.28%	1.35%	1.19%	4'074	66
27.07.06	1.30%	1.35%	1.20%	3'409	65
28.07.06	1.28%	1.35%	1.25%	3'221	67

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
24.07.06	GG	1W	26.07.06	02.08.06	R-Auktion	1.33%	10'348	4'500
25.07.06	GG	1W	27.07.06	03.08.06	R-Auktion	1.33%	7'860	4'500
26.07.06	GG	1W	28.07.06	04.08.06	R-Auktion	1.33%	4'607	4'000

27.07.06	GG	1W	31.07.06	07.08.06	R-Auktion	1.33%	8'190	4'000
28.07.06	GG	1W	02.08.06	09.08.06	R-Auktion	1.33%	4'855	4'002

⁶ GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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