

Kommunikation

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

Zürich, 6. November 2006

Medienmitteilung

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 3. November 2006

Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

Aktiven (in Mio. Franken)	3. November 2006	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	19'502.0	+301.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
Passiven (in Mio. Franken)		
Notenumlauf	38'176.0	+462.9
Girokonten inländischer Banken	4'265.6	-281.9
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität ¹
30.10.06	1.25% - 2.25%	1.86000%	3.54%
31.10.06	1.25% - 2.25%	1.86000%	3.56%
01.11.06	1.25% - 2.25%	1.86000%	3.63%
02.11.06	1.25% - 2.25%	1.86000%	3.65%
03.11.06	1.25% - 2.25%	1.86000%	3.64%

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

22.09.06	4'502	20.10.06	3'845
29.09.06	4'745	27.10.06	4'562
06.10.06	4'962	03.11.06	4'524
13.10.06	4'999		
Schlusswert Periode	4'959		

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
20.09.05 - 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%
20.06.06 - 19.07.06	8'241	9'822	4'737	5'085	119	4.42%
20.07.06 - 19.08.06	8'180	9'565	4'818	4'747	117	4.43%
20.08.06 - 19.09.06	8'142	9'479	4'645	4'834	116	4.57%

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
30.10.06	1.56%	1.70%	1.50%	2'650	57
31.10.06	1.63%	1.70%	1.60%	2'443	50
01.11.06	1.65%	1.70%	1.60%	3'872	69
02.11.06	1.64%	1.67%	1.60%	2'088	43
03.11.06	1.62%	1.65%	1.60%	2'726	56

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
30.10.06	GG	1W	01.11.06	08.11.06	R-Auktion	1.63%	4'150	3'000
31.10.06	GG	1W	02.11.06	09.11.06	R-Auktion	1.63%	5'700	4'501
01.11.06	GG	1W	03.11.06	10.11.06	R-Auktion	1.63%	4'345	4'001

02.11.06	GG	1W	06.11.06	13.11.06	R-Auktion	1.63%	7'115	4'500
03.11.06	GG	1W	07.11.06	14.11.06	R-Auktion	1.64%	2'710	2'710

⁶ GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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