

## Kommunikation

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

Zürich, 27. November 2006

## Medienmitteilung

# Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 24. November 2006

### Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

Aktiven (in Mio. Franken)	24. November 2006	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	20'203.0	+300.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	-650.0
<b>Passiven (in Mio. Franken)</b>		
Notenumlauf	37'697.1	+479.2
Girokonten inländischer Banken	5'389.4	-948.8
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität <sup>1</sup>
20.11.06	1.25% - 2.25%	1.92000%	4.01%
21.11.06	1.25% - 2.25%	1.92083%	3.80%
22.11.06	1.25% - 2.25%	1.92000%	3.72%
23.11.06	1.25% - 2.25%	1.92833%	3.69%
24.11.06	1.25% - 2.25%	1.93333%	3.71%

<sup>1</sup> Repo-Overnight-Index (SNB) vom Vortag + 2%

### Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode (in Mio. Franken) <sup>2</sup>

vergangene Unterlegungsperiode		laufende Unterlegungsperiode	
Durchschnitt bis	Giroguthaben	Durchschnitt bis	Giroguthaben

20.10.06	3'845	24.11.06	5'076
27.10.06	4'562		
03.11.06	4'524		
10.11.06	4'481		
17.11.06	4'717		
Schlusswert Periode	4'822		

<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>
20.10.05 - 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%
20.09.06 - 19.10.06	8'119	9'765	4'810	4'956	120	4.73%

<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
20.11.06	1.80%	1.88%	1.60%	4'651	81
21.11.06	1.72%	1.79%	1.61%	4'600	72
22.11.06	1.69%	1.72%	1.64%	4'378	73
23.11.06	1.71%	1.81%	1.65%	3'361	56
24.11.06	1.76%	1.90%	1.60%	5'183	82

<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
20.11.06	GG	1W	22.11.06	29.11.06	R-Auktion	1.66%	41'435	3'501
21.11.06	GG	1W	23.11.06	30.11.06	R-Auktion	1.66%	36'685	4'501

22.11.06	GG	1W	24.11.06	01.12.06	R-Auktion	1.67%	19'700	4'700
23.11.06	GG	1W	27.11.06	04.12.06	R-Auktion	1.67%	27'255	3'500
24.11.06	GG	1W	28.11.06	05.12.06	R-Auktion	1.67%	37'928	4'000
24.11.06	GG	ON	24.11.06	27.11.06	R-Bilateral	1.89%	1'000	1'000

---

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

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