

## Kommunikation

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

Zürich, 18. Dezember 2006

## Medienmitteilung

# Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 15. Dezember 2006

### Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

Aktiven (in Mio. Franken)	15. Dezember 2006	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	20'002.0	-1'001.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.1	+0.1
<b>Passiven (in Mio. Franken)</b>		
Notenumlauf	39'447.4	+392.8
Girokonten inländischer Banken	3'268.9	-1'576.3
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität <sup>1</sup>
11.12.06	1.25% - 2.25%	1.98000%	3.34%
12.12.06	1.25% - 2.25%	1.98750%	3.63%
13.12.06	1.25% - 2.25%	1.99000%	3.41%
14.12.06	1.50% - 2.50%	2.00000%	3.61%
15.12.06	1.50% - 2.50%	2.01750%	3.75%

<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	01.12.06	5'246
03.11.06	4'524	08.12.06	5'569
10.11.06	4'481	15.12.06	5'145
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
11.12.06	1.63%	1.68%	1.55%	4'981	78
12.12.06	1.41%	1.63%	1.20%	2'188	53
13.12.06	1.61%	1.75%	1.45%	4'073	70
14.12.06	1.75%	1.90%	0.74%	4'138	68
15.12.06	2.14%	2.30%	1.87%	6'047	102

<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
11.12.06	GG	1W	13.12.06	20.12.06	R-Auktion	1.68%	25'273	6'000
12.12.06	GG	1W	14.12.06	21.12.06	R-Auktion	1.68%	35'191	4'000

13.12.06	GG	1W	15.12.06	22.12.06	R-Auktion	1.68%	47'933	3'501
14.12.06	GG	1W	18.12.06	27.12.06	R-Auktion	1.87%	6'220	3'501
15.12.06	GG	2W	19.12.06	03.01.07	R-Auktion	1.89%	29'000	4'000
15.12.06	GG	TN	18.12.06	19.12.06	R-Bilateral	2.10%	2'500	2'500

---

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

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