

Kommunikation

Postfach, CH-8022 Zürich
Telefon +41 1 631 31 11
Telefax +41 1 631 39 10
www.snb.ch
snb@.snb.ch

Zürich, 16. August 2004

Medienmitteilung

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 13. August 2004

Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

| Aktiven (in Mio. Franken) | 13. August 2004 | Veränderungen gegenüber Vorwoche |
|-----------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------------------------|
| Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften | 23'241.0 | -493.0 |
| Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität | 0.0 | -1.9 |
| Passiven (in Mio. Franken) | | |
| Notenumlauf | 35'282.5 | -390.9 |
| Girokonten inländischer Banken | 4'548.6 | -2'145.8 |
| Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften | 0.0 | 0.0 |

Referenzzinssätze SNB

| Datum | Zielband für Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor | Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität ¹ |
|----------|----------------------------------|------------------|--------------------------------------------------------|
| 09.08.04 | 0.00% - 1.00% | 0.50000% | 2.11% |
| 10.08.04 | 0.00% - 1.00% | 0.50333% | 2.13% |
| 11.08.04 | 0.00% - 1.00% | 0.52000% | 2.11% |
| 12.08.04 | 0.00% - 1.00% | 0.52000% | 2.14% |
| 13.08.04 | 0.00% - 1.00% | 0.51917% | 2.25% |

¹ Repo-Overnight-Index (SNB) vom Vortag + 2%
Der Lombardsatz entspricht bis Ende 2005 dem Sondersatz.

Repo-Overnight-Index (SNB)

| Datum | Referenzzsatz (gewichtet) ² | Tageshöchst | Tagestiefst | Handelsvolumen in Mio. Franken | Anzahl Geschäfte |
|----------|-------------------------------------------|-------------|-------------|-----------------------------------|---------------------|
| 09.08.04 | 0.13% | 0.20% | 0.03% | 1'051 | 23 |

| | | | | | |
|----------|-------|-------|-------|-------|----|
| 10.08.04 | 0.11% | 0.15% | 0.07% | 1'738 | 35 |
| 11.08.04 | 0.14% | 0.25% | 0.08% | 2'174 | 39 |
| 12.08.04 | 0.25% | 0.28% | 0.18% | 3'031 | 41 |
| 13.08.04 | 0.34% | 0.40% | 0.25% | 3'896 | 57 |

² Definition siehe www.snb.ch (Aktuelles, Geldpolitisch wichtige Daten)

Tagesergebnisse der geldpolitischen Geschäfte (in Mio. Franken)

| Abschluss | SNB ³ | Kontrakt | von | bis | Art | Preis ⁴ | Gebote | Zuteilung |
|-----------|------------------|----------|----------|----------|-----------|--------------------|--------|-----------|
| 09.08.04 | GG | 1W | 11.08.04 | 18.08.04 | R-Auktion | 0.26% | 39'005 | 3'997 |
| 10.08.04 | GG | 1W | 12.08.04 | 19.08.04 | R-Auktion | 0.26% | 17'779 | 5'002 |
| 11.08.04 | GG | 1W | 13.08.04 | 20.08.04 | R-Auktion | 0.25% | 1'591 | 1'591 |
| 12.08.04 | GG | 1W | 16.08.04 | 23.08.04 | R-Auktion | 0.26% | 26'015 | 6'004 |
| 13.08.04 | GG | 2W | 17.08.04 | 31.08.04 | R-Auktion | 0.27% | 32'663 | 4'999 |
| 13.08.04 | GG | ON | 13.08.04 | 16.08.04 | R-Auktion | 0.33% | 3'150 | 3'150 |

³ GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

⁴ bei bilateralen Geschäften: Durchschnittssatz; bei Swaps: Terminauf- bzw. abschläge (Pips)