

Kommunikation

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

Zürich, 3. Oktober 2005

Medienmitteilung

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 30. September 2005

Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB

Aktiven (in Mio. Franken)	30. September 2005	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	22'004.0	+1'503.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazilität	0.0	0.0
Passiven (in Mio. Franken)		
Notenumlauf	37'194.8	+771.4
Girokonten inländischer Banken	5'784.7	+1'229.4
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazilität ¹
26.09.05	0.25% - 1.25%	0.76000%	2.63%
27.09.05	0.25% - 1.25%	0.76000%	2.63%
28.09.05	0.25% - 1.25%	0.77000%	2.63%
29.09.05	0.25% - 1.25%	0.78000%	2.64%
30.09.05	0.25% - 1.25%	0.79000%	2.63%

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

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode (in Mio. Franken) ²

vergangene Unterlegungsperiode	laufende Unterlegungsperiode
Durchschnitt bis Giroguthaben	Durchschnitt bis Giroguthaben

26.08.05	4'515	23.09.05	4'734
02.09.05	4'539	30.09.05	4'681
09.09.05	4'544		
16.09.05	4'499		
Schlusswert Periode	4'457		

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
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
20.01.05 - 19.02.05	7'343	9'343	4'462	4'881	127	3.72%
20.02.05 - 19.03.05	7'431	9'260	4'494	4'766	125	3.72%
20.03.05 - 19.04.05	7'504	9'378	4'606	4'771	125	3.74%
20.04.05 - 19.05.05	7'627	9'548	4'599	4'949	125	3.74%
20.05.05 - 19.06.05	7'666	9'158	4'569	4'589	119	3.73%
20.06.05 - 19.07.05	7'682	9'206	4'676	4'530	120	3.73%
20.07.05 - 19.08.05	7'616	9'122	4'632	4'490	120	3.74%

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
26.09.05	0.63%	0.67%	0.61%	3'194	50
27.09.05	0.63%	0.67%	0.61%	4'590	66
28.09.05	0.64%	0.66%	0.60%	3'577	57
29.09.05	0.63%	0.66%	0.60%	2'814	49
30.09.05	0.68%	0.70%	0.60%	4'186	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
26.09.05	GG	1W	28.09.05	05.10.05	R-Auktion	0.65%	22'600	2'201
27.09.05	GG	1W	29.09.05	06.10.05	R-Auktion	0.65%	20'851	4'000
28.09.05	GG	1W	30.09.05	07.10.05	R-Auktion	0.65%	16'030	5'002

29.09.05	GG	1W	03.10.05	10.10.05	R-Auktion	0.65%	23'515	4'500
30.09.05	GG	1W	04.10.05	11.10.05	R-Auktion	0.65%	28'134	3'600
30.09.05	GG	ON	30.09.05	03.10.05	R-Bilateral	0.90%	1'000	700

⁶ GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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