

**Kommunikation**

Postfach, CH-8022 Zürich  
 Telefon +41 44 631 31 11  
 Telefax +41 44 631 39 10

Zürich, 25. Juni 2007

## Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 22. Juni 2007

### Geldpolitisch relevante Aktiven und Passiven der SNB (in Mio. Franken)

<b>Aktiven</b>	22. Juni 2007	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	19'299.0	+1'798.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
<b>Passiven</b>		
Notenumlauf	38'297.2	+256.9
Girokonten inländischer Banken	4'010.2	+1'306.2
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
18.06.07	2.00% - 3.00%	2.49750%	4.36%
19.06.07	2.00% - 3.00%	2.49833%	4.13%
20.06.07	2.00% - 3.00%	2.54000%	4.01%
21.06.07	2.00% - 3.00%	2.57000%	4.42%
22.06.07	2.00% - 3.00%	2.66750%	4.55%

\* Repo-Overnight-Index (SNB) vom Vortag + 2%

**Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode\***

(in Mio. Franken)

vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben	laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben
25.05.07	6'005	22.06.07	4'469
01.06.07	5'786		
08.06.07	5'748		
15.06.07	5'446		
Schlusswert Periode	5'228		

\* 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*	Noten Münzen	Giro- guthaben	Erfüllungs- grad in %	Zinssatz**
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	4'644	4'834	116	4.57%
20.09.06 - 19.10.06	8'119	9'765	4'810	4'956	120	4.73%
20.10.06 - 19.11.06	8'184	9'464	4'643	4'821	116	4.74%
20.11.06 - 19.12.06	8'314	9'857	4'774	5'083	119	4.89%
20.12.06 - 19.01.07	8'404	10'550	5'359	5'191	126	5.06%
20.01.07 - 19.02.07	8'489	9'958	4'732	5'226	117	5.08%
20.02.07 - 19.03.07	8'541	10'330	4'851	5'479	121	5.15%
20.03.07 - 19.04.07	8'639	10'321	5'027	5'295	119	5.22%
20.04.07 - 19.05.07	8'729	10'110	4'910	5'200	116	5.22%

\* Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben

\*\* Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses

### Repo-Overnight-Index (SNB)

Datum	Referenzsatz (gewichtet)*	Tageshöchst	Tagestiefst	Handelsvolumen in Mio. Franken	Anzahl Geschäfte
18.06.07	2.13%	2.25%	1.50%	3'144	70
19.06.07	2.01%	2.20%	1.70%	4'726	85
20.06.07	2.42%	2.55%	2.30%	4'156	73
21.06.07	2.55%	2.65%	2.40%	4'947	77
22.06.07	2.58%	2.70%	2.50%	3'624	62

\* Der Repo-Overnight-Index (SNB) ist der nach Handelsvolumen gewichtete Durchschnitt der Zinssätze der zwischen den Geschäftsbanken über die Eurex Repo-Handelsplattform abgeschlossenen Overnight-GC-Geschäfte. Berücksichtigt werden Abschlüsse mit SNB-repofähigen Effekten. Die SNB veröffentlicht die von der Eurex Zürich AG berechneten Daten.

### Tagesergebnisse der geldpolitischen Geschäfte

(in Mio. Franken)

Abschluss	SNB*	Kontrakt	von	bis	Art	Preis**	Gebote	Zuteilung
18.06.07	GG	1W	20.06.07	27.06.07	R-Auktion	2.35%	4'012	2'999
19.06.07	GG	SN	21.06.07	22.06.07	R-Auktion	2.35%	7'822	3'000
20.06.07	GG	1W	22.06.07	29.06.07	R-Auktion	2.40%	5'105	2'299
21.06.07	GG	1W	25.06.07	02.07.07	R-Auktion	2.40%	32'869	5'400
21.06.07	GG	Non-Std	25.06.07	28.06.07	R-Auktion	2.40%	6'662	4'001
22.06.07	GG	1W	26.06.07	03.07.07	R-Auktion	2.43%	59'392	7'600

\* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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