

Kommunikation

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

Zürich, 17. September 2007

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 14. September 2007

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

Aktiven	14. September 2007	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinstierungsgeschäften	20'003.0	-298.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
Passiven		
Notenumlauf	37'671.0	-499.5
Girokonten inländischer Banken	5'159.4	-87.4
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	259.0	+259.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
10.09.07	2.00% - 3.00%	2.90083%	3.99%
11.09.07	2.00% - 3.00%	2.90000%	4.22%
12.09.07	2.00% - 3.00%	2.88833%	3.96%
13.09.07	2.25% - 3.25%	2.88333%	3.89%
14.09.07	2.25% - 3.25%	2.79167%	4.31%

* 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
20.07.07	5'064	24.08.07	5'471
27.07.07	5'191	31.08.07	5'513
03.08.07	5'166	07.09.07	5'534
10.08.07	5'413	14.09.07	5'434
17.08.07	5'435		
Schlusswert Periode	5'351		

* 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**
20.07.06 - 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%
20.05.07 - 19.06.07	8'725	10'081	4'854	5'227	116	5.36%
20.06.07 - 19.07.07	8'676	10'191	4'960	5'232	117	5.60%

* 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
10.09.07	2.22%	2.36%	2.10%	4'594	78
11.09.07	1.96%	2.22%	1.50%	3'829	68
12.09.07	1.89%	2.05%	1.60%	3'469	71
13.09.07	2.31%	2.50%	2.00%	4'089	85
14.09.07	2.02%	2.17%	1.25%	4'711	73

* 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
10.09.07	GG	1W	12.09.07	19.09.07	R-Auktion	2.29%	14'035	3'000
11.09.07	GN	ON	11.09.07	12.09.07	R-Bilateral	1.79%	306	306
11.09.07	GG	1W	13.09.07	20.09.07	R-Auktion	2.29%	9'082	3'000
12.09.07	GN	ON	12.09.07	13.09.07	R-Bilateral	1.79%	985	985
12.09.07	GG	1W	14.09.07	21.09.07	R-Auktion	2.29%	8'923	4'000
13.09.07	GG	3M	17.09.07	17.12.07	R-Auktion	2.39%	9'760	5'000
13.09.07	GG	TN	14.09.07	17.09.07	R-Auktion	2.14%	3'280	1'502
14.09.07	GN	ON	14.09.07	17.09.07	R-Bilateral	1.83%	259	259
14.09.07	GG	1W	18.09.07	25.09.07	R-Auktion	2.08%	28'850	5'000

* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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