

Kommunikation

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

Zürich, 21. Januar 2008

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 18. Januar 2008

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

Aktiven	18. Januar 2008	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	21'545.0	-2'260.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
Passiven		
Notenumlauf	40'161.8	-1'583.1
Girokonten inländischer Banken	2'591.6	-1'013.2
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	925.0	+125.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
14.01.08	2.25% - 3.25%	2.71000%	3.81%
15.01.08	2.25% - 3.25%	2.68500%	4.17%
16.01.08	2.25% - 3.25%	2.64833%	4.05%
17.01.08	2.25% - 3.25%	2.66667%	4.04%
18.01.08	2.25% - 3.25%	2.67667%	3.91%

* 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
23.11.07	5'653	21.12.07	5'755
30.11.07	5'607	28.12.07	5'344
07.12.07	5'497	04.01.08	5'983
14.12.07	5'379	11.01.08	5'595
		18.01.08	5'159
Schlusswert Periode	5'298		

* 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**
20.11.06 - 19.12.06	8'314	9'857	4'774	5'083	119	-
20.12.06 - 19.01.07	8'404	10'550	5'359	5'191	126	-
20.01.07 - 19.02.07	8'489	9'958	4'732	5'226	117	-
20.02.07 - 19.03.07	8'541	10'330	4'851	5'479	121	-
20.03.07 - 19.04.07	8'639	10'321	5'027	5'295	119	-
20.04.07 - 19.05.07	8'729	10'110	4'910	5'200	116	6.09%
20.05.07 - 19.06.07	8'725	10'081	4'854	5'227	116	6.05%
20.06.07 - 19.07.07	8'676	10'191	4'960	5'232	117	6.38%
20.07.07 - 19.08.07	8'650	10'131	4'782	5'349	117	6.31%
20.08.07 - 19.09.07	8'654	10'069	4'786	5'283	116	6.10%
20.09.07 - 19.10.07	8'665	10'098	5'007	5'092	117	5.97%
20.10.07 - 19.11.07	8'761	10'150	4'893	5'258	116	6.00%

* 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
14.01.08	2.17%	2.35%	1.95%	8'793	130
15.01.08	2.05%	2.13%	1.90%	8'891	128
16.01.08	2.04%	2.15%	1.90%	6'640	109
17.01.08	1.91%	2.08%	1.50%	5'556	86
18.01.08	2.04%	2.25%	1.50%	6'591	112

* 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
14.01.08	GG	1W	16.01.08	23.01.08	R-Auktion	2.05%	8'152	4'000
14.01.08	GG	ON	14.01.08	15.01.08	R-Bilateral	2.30%	582	582
15.01.08	GG	1W	17.01.08	24.01.08	R-Auktion	2.05%	12'836	6'501
16.01.08	GG	1W	18.01.08	25.01.08	R-Auktion	2.08%	6'210	2'500
17.01.08	GN	ON	17.01.08	18.01.08	R-Bilateral	1.88%	1'200	1'200
17.01.08	GG	1W	21.01.08	28.01.08	R-Auktion	2.13%	13'216	3'000
18.01.08	GN	ON	18.01.08	21.01.08	R-Bilateral	1.90%	925	925
18.01.08	GG	1W	22.01.08	29.01.08	R-Auktion	2.15%	17'924	5'501

* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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