

Kommunikation

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

Zürich, 1. September 2008

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 29. August 2008

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

| Aktiven | 29. August 2008 | Veränderungen gegenüber Vorwoche |
|---|-----------------|-------------------------------------|
| Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften | 33'306.0 | +204.0 |
| Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität | 0.0 | 0.0 |
| Passiven | | |
| Notenumlauf | 40'236.9 | +776.2 |
| Girokonten inländischer Banken | 5'221.3 | -256.0 |
| Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften | 0.0 | 0.0 |

Referenzzinssätze SNB

| Datum | Zielband für Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor | Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität* |
|----------|----------------------------------|------------------|--|
| 25.08.08 | 2.25% - 3.25% | - | 3.83% |
| 26.08.08 | 2.25% - 3.25% | 2.74583% | 3.84% |
| 27.08.08 | 2.25% - 3.25% | 2.74250% | 3.77% |
| 28.08.08 | 2.25% - 3.25% | 2.74833% | 3.72% |
| 29.08.08 | 2.25% - 3.25% | 2.74500% | 3.84% |

* 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 |
|--|--------------|--|--------------|
| 25.07.08 | 5'092 | 22.08.08 | 5'415 |
| 01.08.08 | 5'173 | 29.08.08 | 5'245 |
| 08.08.08 | 5'090 | | |
| 15.08.08 | 5'094 | | |
| Schlusswert Periode | 5'189 | | |

* 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** |
|---------------------|-------------|--------------------------|-----------------|-------------------|--------------------------|------------|
| 20.07.07 - 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% |
| 20.11.07 - 19.12.07 | 8'865 | 10'502 | 5'205 | 5'297 | 118 | 5.98% |
| 20.12.07 - 19.01.08 | 9'008 | 11'082 | 6'006 | 5'076 | 123 | 5.90% |
| 20.01.08 - 19.02.08 | 9'029 | 10'460 | 5'448 | 5'011 | 116 | 6.27% |
| 20.02.08 - 19.03.08 | 9'068 | 10'790 | 5'545 | 5'245 | 119 | 6.19% |
| 20.03.08 - 19.04.08 | 9'091 | 11'548 | 6'037 | 5'511 | 127 | 5.89% |
| 20.04.08 - 19.05.08 | 9'228 | 10'702 | 5'761 | 4'941 | 116 | 5.74% |
| 20.05.08 - 19.06.08 | 9'371 | 10'877 | 5'545 | 5'332 | 116 | 5.83% |
| 20.06.08 - 19.07.08 | 9'403 | 10'822 | 5'685 | 5'137 | 115 | 5.81% |

* 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 |
|----------|------------------------------|-------------|-------------|-----------------------------------|------------------|
| 25.08.08 | 1.84% | 1.93% | 1.50% | 5'370 | 83 |
| 26.08.08 | 1.77% | 1.97% | 1.55% | 4'035 | 66 |
| 27.08.08 | 1.72% | 1.97% | 1.50% | 5'114 | 87 |
| 28.08.08 | 1.84% | 1.98% | 1.65% | 6'104 | 105 |
| 29.08.08 | 1.90% | 2.10% | 0.75% | 5'720 | 99 |

* 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 |
|-----------|------|----------|----------|----------|-------------|---------|--------|-----------|
| 25.08.08 | GG | 1W | 27.08.08 | 03.09.08 | R-Auktion | 1.90% | 22'401 | 6'500 |
| 26.08.08 | GN | ON | 26.08.08 | 27.08.08 | R-Bilateral | 1.65% | 600 | 600 |
| 26.08.08 | GG | 1W | 28.08.08 | 04.09.08 | R-Auktion | 1.90% | 23'177 | 6'503 |
| 27.08.08 | GN | ON | 27.08.08 | 28.08.08 | R-Bilateral | 1.65% | 1'000 | 1'000 |
| 27.08.08 | GG | 1W | 29.08.08 | 05.09.08 | R-Auktion | 1.90% | 28'991 | 6'301 |
| 28.08.08 | GG | 1W | 01.09.08 | 08.09.08 | R-Auktion | 1.90% | 11'616 | 5'500 |
| 29.08.08 | GG | 1W | 02.09.08 | 09.09.08 | R-Auktion | 1.90% | 11'005 | 6'000 |

* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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