

**Kommunikation**

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

Zürich, 20. Oktober 2008

## Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 17. Oktober 2008

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

<b>Aktiven</b>	17. Oktober 2008	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinstierungsgeschäften	43'754.0	-6'433.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
<b>Passiven</b>		
Notenumlauf	43'050.4	+328.5
Girokonten inländischer Banken	7'502.2	-120.3
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	3'414.0	-6'536.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
13.10.08	2.00% - 3.00%	3.12000%	2.98%
14.10.08	2.00% - 3.00%	3.10000%	2.86%
15.10.08	2.00% - 3.00%	3.09833%	3.06%
16.10.08	2.00% - 3.00%	3.09333%	3.12%
17.10.08	2.00% - 3.00%	3.09000%	3.20%

\* 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
22.08.08	5'415	26.09.08	5'942
29.08.08	5'245	03.10.08	6'406
05.09.08	5'189	10.10.08	7'535
12.09.08	5'154	17.10.08	7'619
19.09.08	5'096		
Schlusswert Periode	5'096		

\* 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**
20.08.07 - 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	9'009	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	9'373	10'877	5'545	5'332	116	5.83%
20.06.08 - 19.07.08	9'407	10'822	5'685	5'137	115	5.81%
20.07.08 - 19.08.08	9'295	10'858	5'675	5'183	117	5.87%

\* Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben

\*\* Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses

### Repo-Overnight-Index (SNB)

Datum	Referenzzsatz (gewichtet)*	Tageshöchst	Tagestiefst	Handelsvolumen in Mio. Franken	Anzahl Geschäfte
13.10.08	0.86%	1.45%	0.50%	5'660	96
14.10.08	1.06%	1.50%	0.80%	9'820	144
15.10.08	1.12%	1.50%	0.75%	9'877	137
16.10.08	1.20%	1.50%	0.80%	10'562	168
17.10.08	1.12%	1.50%	0.75%	7'915	128

\* 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
13.10.08	GN	ON	13.10.08	14.10.08	R-Bilateral	0.99%	8'321	8'321
13.10.08	GG	1W	15.10.08	22.10.08	R-Auktion	1.25%	5'383	5'383
14.10.08	GN	ON	14.10.08	15.10.08	R-Bilateral	1.00%	4'500	4'500
14.10.08	GG	1W	16.10.08	23.10.08	R-Auktion	1.25%	4'983	4'983
15.10.08	GN	ON	15.10.08	16.10.08	R-Bilateral	1.00%	3'600	3'600
15.10.08	GG	1W	17.10.08	24.10.08	R-Auktion	1.25%	6'358	6'358
16.10.08	GG	1W	20.10.08	27.10.08	R-Auktion	1.25%	10'155	10'155
17.10.08	GN	ON	17.10.08	20.10.08	R-Bilateral	1.00%	3'414	3'414
17.10.08	GG	1W	21.10.08	28.10.08	R-Auktion	1.25%	5'911	5'911
17.10.08	GG	ON	17.10.08	20.10.08	R-Bilateral	1.50%	740	740

\* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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