

**Kommunikation**

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

Zürich, 23. November 2009

## Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 20. November 2009

### Referenzzinssätze SNB

| Datum    | Zielband für<br>Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor | Sondersatz<br>Engpassfinanzierungsfazilität* |
|----------|----------------------------------|------------------|--|
| 16.11.09 | 0.00% - 0.75%                    | 0.25500%         | 0.53%  |
| 17.11.09 | 0.00% - 0.75%                    | 0.25500%         | 0.53%  |
| 18.11.09 | 0.00% - 0.75%                    | 0.25333%         | 0.53%  |
| 19.11.09 | 0.00% - 0.75%                    | 0.25167%         | 0.52%  |
| 20.11.09 | 0.00% - 0.75%                    | 0.25167%         | 0.52%  |

\* Bis 24.08.2009: Repo-Overnight-Index (SNB) vom Vortag + 50 Basispunkte. Ab 25.08.2009: SARON (Swiss Average Rate Overnight), 12.00 Uhr Fixing + 50 Basispunkte.

### Swiss Average Rates\*

| Datum    | SARON<br>12.00 Uhr Fixing | SARON<br>Handelsschluss | SAR1W<br>Handelsschluss | SAR1M<br>Handelsschluss | SAR3M<br>Handelsschluss |
|----------|---------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 16.11.09 | 0.026%                    | 0.026%                  | 0.046%                  | 0.060%                  | 0.140%                  |
| 17.11.09 | 0.027%                    | 0.028%                  | 0.045%                  | 0.063%                  | 0.080%                  |
| 18.11.09 | 0.026%                    | 0.022%                  | 0.045%                  | 0.067%                  | 0.150%                  |
| 19.11.09 | 0.025%                    | 0.022%                  | 0.045%                  | 0.064%                  | 0.150%                  |
| 20.11.09 | 0.025%                    | 0.022%                  | 0.048%                  | 0.058%                  | 0.116%                  |

\* Die Swiss Average Rates sind volumengewichtete Durchschnittssätze, die auf abgeschlossenen Transaktionen und Referenzpreisen des jeweiligen Handestages basieren. Die Berechnung der Referenzpreise stützt sich auf verfügbare Quotes im Orderbuch der elektronischen Handelsplattform der Eurex. Die Swiss Average Rates werden durch die SIX Swiss Exchange berechnet.

**Giroguthaben inländischer Banken im Wochendurchschnitt**

(in Mio. Franken)

Durchschnitt für die Woche zum 20. November 2009

44'556

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

(in Mio. Franken)

| vergangene Unterlegungsperiode<br>Durchschnitt bis | Giroguthaben | laufende Unterlegungsperiode<br>Durchschnitt bis | Giroguthaben |
|--|--------------|--|--------------|
| 23.10.09   | 46'650       | 20.11.09   | 47'503       |
| 30.10.09   | 45'356       |  |              |
| 06.11.09   | 44'097       |  |              |
| 13.11.09   | 43'651       |  |              |
| Schlusswert<br>Periode                             | 43'731       |  |              |

\* 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<br>Aktiven* | Noten<br>Münzen | Giro-<br>guthaben | Erfüllungs-<br>grad in % | Zinssatz** |
|---------------------|-------------|--------------------------|-----------------|-------------------|--------------------------|------------|
| 20.09.08 - 19.10.08 | 8'984       | 14'043                   | 6'433           | 7'610             | 156                      | 5.24%      |
| 20.10.08 - 19.11.08 | 9'039       | 14'435                   | 6'600           | 7'835             | 160                      | 4.43%      |
| 20.11.08 - 19.12.08 | 9'162       | 31'164                   | 6'559           | 24'605            | 340                      | 4.05%      |
| 20.12.08 - 19.01.09 | 9'239       | 45'750                   | 7'431           | 38'319            | 495                      | 4.02%      |
| 20.01.09 - 19.02.09 | 9'096       | 52'506                   | 6'403           | 46'103            | 577                      | 4.03%      |
| 20.02.09 - 19.03.09 | 8'990       | 52'526                   | 6'503           | 46'023            | 584                      | 4.02%      |
| 20.03.09 - 19.04.09 | 8'937       | 74'472                   | 6'515           | 67'957            | 833                      | 4.02%      |
| 20.04.09 - 19.05.09 | 8'910       | 72'983                   | 6'342           | 66'641            | 819                      | 4.03%      |
| 20.05.09 - 19.06.09 | 8'917       | 66'421                   | 5'841           | 60'580            | 745                      | 4.02%      |
| 20.06.09 - 19.07.09 | 8'783       | 72'650                   | 5'739           | 66'911            | 827                      | 4.02%      |
| 20.07.09 - 19.08.09 | 8'855       | 68'344                   | 5'886           | 62'458            | 772                      | 4.02%      |
| 20.08.09 - 19.09.09 | 8'889       | 60'246                   | 5'571           | 54'674            | 678                      | 4.02%      |

\* Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben.

\*\* Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.