

**Kommunikation**

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

Zürich, 21. Mai 2007

## Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 18. Mai 2007

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

<b>Aktiven</b>	18. Mai 2007	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinstierungsgeschäften	20'136.0	-169.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	587.0	+587.0
<b>Passiven</b>		
Notenumlauf	38'321.5	+2.3
Girokonten inländischer Banken	5'690.3	+340.9
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
14.05.07	1.75% - 2.75%	2.38583%	3.99%
15.05.07	1.75% - 2.75%	2.40000%	4.14%
16.05.07	1.75% - 2.75%	2.41000%	4.19%
17.05.07	1.75% - 2.75%	2.41000%	-
18.05.07	1.75% - 2.75%	2.42000%	4.23%

\* 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
23.03.07	6'652	20.04.07	4'728
30.03.07	6'342	27.04.07	4'945
06.04.07	5'833	04.05.07	5'223
13.04.07	5'487	11.05.07	5'255
		18.05.07	5'187
Schlusswert Periode	5'301		

\* 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**
20.03.06 - 19.04.06	8'155	9'795	4'937	4'859	120	4.16%
20.04.06 - 19.05.06	8'225	10'023	4'724	5'300	122	4.27%
20.05.06 - 19.06.06	8'285	10'473	4'845	5'627	126	4.34%
20.06.06 - 19.07.06	8'241	9'822	4'737	5'085	119	4.42%
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%

\* 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
14.05.07	2.14%	2.25%	2.06%	3'345	66
15.05.07	2.19%	2.30%	2.08%	3'406	67
16.05.07	2.23%	2.40%	2.15%	3'158	67
17.05.07	-	-	-	-	-
18.05.07	2.34%	2.75%	1.75%	3'833	86

\* 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
14.05.07	GG	1W	16.05.07	23.05.07	R-Auktion	2.12%	14'155	3'201
15.05.07	GG	1W	18.05.07	25.05.07	R-Auktion	2.12%	28'220	6'400
16.05.07	GG	1W	21.05.07	29.05.07	R-Auktion	2.12%	32'773	3'700
17.05.07	-	-	-	-	-	-	-	-
18.05.07	GG	1W	22.05.07	29.05.07	R-Auktion	2.13%	30'375	3'001

\* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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