

Kommunikation

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

Zürich, 24. Dezember 2007

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 21. Dezember 2007

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

Aktiven	21. Dezember 2007	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	26'007.0	+3'003.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.1	0.0
Passiven		
Notenumlauf	42'813.5	+2'475.1
Girokonten inländischer Banken	5'294.7	+119.5
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	655.0	+645.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
17.12.07	2.25% - 3.25%	2.78167%	3.84%
18.12.07	2.25% - 3.25%	2.78000%	3.83%
19.12.07	2.25% - 3.25%	2.77500%	3.80%
20.12.07	2.25% - 3.25%	2.77167%	3.81%
21.12.07	2.25% - 3.25%	2.76833%	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
23.11.07	5'653	21.12.07	5'755
30.11.07	5'607		
07.12.07	5'497		
14.12.07	5'379		
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**
20.10.06 - 19.11.06	8'184	9'464	4'643	4'821	116	-
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%

* 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
17.12.07	1.83%	1.90%	1.70%	6'176	95
18.12.07	1.80%	1.95%	1.25%	5'249	81
19.12.07	1.81%	1.90%	1.50%	5'152	90
20.12.07	1.84%	1.92%	1.70%	4'831	78
21.12.07	1.86%	2.03%	1.78%	3'364	66

* 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
17.12.07	GN	ON	17.12.07	18.12.07	R-Bilateral	1.80%	1'800	1'800
17.12.07	GG	3W	19.12.07	09.01.08	R-Auktion	2.10%	15'221	2'002
18.12.07	GN	ON	18.12.07	19.12.07	R-Bilateral	1.80%	1'500	1'500
18.12.07	GG	1W	20.12.07	27.12.07	R-Auktion	2.05%	4'681	2'800
19.12.07	GG	1W	21.12.07	28.12.07	R-Auktion	2.05%	10'600	4'201
20.12.07	GG	1W	24.12.07	31.12.07	R-Auktion	2.05%	5'200	3'001
21.12.07	GN	ON	21.12.07	24.12.07	R-Bilateral	1.80%	655	655
21.12.07	GG	1W	27.12.07	03.01.08	R-Auktion	2.05%	27'782	3'001

* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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