

**Kommunikation**

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

Zürich, 29. Januar 2007

## Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 26. Januar 2007

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

<b>Aktiven</b>	26. Januar 2007	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinstierungsgeschäften	22'004.0	+2'121.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
<b>Passiven</b>		
Notenumlauf	38'992.0	+146.2
Girokonten inländischer Banken	5'785.1	+2'126.4
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
22.01.07	1.50% - 2.50%	2.16000%	3.69%
23.01.07	1.50% - 2.50%	2.16000%	3.98%
24.01.07	1.50% - 2.50%	2.15500%	3.95%
25.01.07	1.50% - 2.50%	2.15583%	3.96%
26.01.07	1.50% - 2.50%	2.16000%	3.91%

\* 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
22.12.06	5'444	26.01.07	4'823
29.12.06	5'532		
05.01.07	5'814		
12.01.07	5'610		
19.01.07	5'200		
Schlusswert Periode	5'200		

\* 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**
20.12.05 - 19.01.06	7'960	9'995	5'036	4'959	126	3.90%
20.01.06 - 19.02.06	8'032	9'451	4'839	4'612	118	3.91%
20.02.06 - 19.03.06	8'055	10'042	4'884	5'157	125	4.03%
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%

\* 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
22.01.07	1.98%	2.05%	1.85%	6'382	100
23.01.07	1.95%	2.03%	1.88%	4'250	71
24.01.07	1.96%	2.00%	1.91%	3'304	62
25.01.07	1.91%	2.00%	1.85%	4'731	80
26.01.07	1.86%	1.95%	1.60%	4'199	71

\* Definition siehe [www.snb.ch](http://www.snb.ch) (Aktuelles, Geldpolitisch wichtige Daten)

### Tagesergebnisse der geldpolitischen Geschäfte

(in Mio. Franken)

Abschluss	SNB*	Kontrakt	von	bis	Art	Preis**	Gebote	Zuteilung
22.01.07	GG	1W	24.01.07	31.01.07	R-Auktion	1.90%	38'777	3'000
23.01.07	GG	1W	25.01.07	01.02.07	R-Auktion	1.91%	62'881	5'502
24.01.07	GG	1W	26.01.07	02.02.07	R-Auktion	1.91%	57'337	4'501
25.01.07	GG	1W	29.01.07	05.02.07	R-Auktion	1.92%	41'353	5'500
26.01.07	GG	1W	30.01.07	06.02.07	R-Auktion	1.92%	47'095	3'500

\* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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