

**Kommunikation**

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

Zürich, 5. Februar 2007

## Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 2. Februar 2007

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

<b>Aktiven</b>	2. Februar 2007	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	22'002.0	-2.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
<b>Passiven</b>		
Notenumlauf	39'469.2	+477.2
Girokonten inländischer Banken	5'305.7	-479.4
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
29.01.07	1.50% - 2.50%	2.16500%	3.86%
30.01.07	1.50% - 2.50%	2.17250%	3.86%
31.01.07	1.50% - 2.50%	2.19000%	3.98%
01.02.07	1.50% - 2.50%	2.20583%	3.90%
02.02.07	1.50% - 2.50%	2.21000%	3.96%

\* 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	02.02.07	5'093
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
29.01.07	1.86%	1.95%	1.70%	3'429	58
30.01.07	1.98%	2.05%	1.85%	3'197	72
31.01.07	1.90%	2.05%	1.65%	4'126	63
01.02.07	1.96%	2.03%	1.92%	4'760	77
02.02.07	1.91%	2.00%	1.50%	3'586	61

\* 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
29.01.07	GG	1W	31.01.07	07.02.07	R-Auktion	1.92%	52'825	2'500
30.01.07	GG	1W	01.02.07	08.02.07	R-Auktion	1.92%	63'477	5'501
31.01.07	GG	1W	02.02.07	09.02.07	R-Auktion	1.92%	62'069	5'001
01.02.07	GG	1W	05.02.07	12.02.07	R-Auktion	1.92%	56'365	5'500
02.02.07	GG	1W	06.02.07	13.02.07	R-Auktion	1.92%	53'278	3'001

\* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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