

**Kommunikation**

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

Zürich, 29. Mai 2007

## Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 25. Mai 2007

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

<b>Aktiven</b>	25. Mai 2007	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinstierungsgeschäften	21'003.0	+867.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	-587.0
<b>Passiven</b>		
Notenumlauf	38'546.6	+225.1
Girokonten inländischer Banken	5'702.3	+12.0
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
21.05.07	1.75% - 2.75%	2.42250%	4.34%
22.05.07	1.75% - 2.75%	2.43000%	4.12%
23.05.07	1.75% - 2.75%	2.46000%	4.07%
24.05.07	1.75% - 2.75%	2.45500%	4.03%
25.05.07	1.75% - 2.75%	2.45917%	3.99%

\* 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
20.04.07	4'728	25.05.07	6'005
27.04.07	4'945		
04.05.07	5'223		
11.05.07	5'255		
18.05.07	5'187		
Schlusswert Periode	5'203		

\* 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**
20.04.06 - 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%
20.03.07 - 19.04.07	8'639	10'321	5'027	5'295	119	5.22%

\* 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
21.05.07	2.12%	2.20%	2.08%	4'280	71
22.05.07	2.07%	2.14%	2.03%	3'692	64
23.05.07	2.03%	2.12%	2.00%	4'015	70
24.05.07	1.99%	2.05%	1.91%	4'439	78
25.05.07	1.94%	2.12%	1.85%	5'013	80

\* 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
21.05.07	GG	1W	23.05.07	30.05.07	R-Auktion	2.14%	31'330	3'500
22.05.07	GG	1W	24.05.07	31.05.07	R-Auktion	2.14%	22'834	4'800
23.05.07	GG	1W	25.05.07	01.06.07	R-Auktion	2.14%	10'491	3'002
23.05.07	GG	Non-Std	25.05.07	04.06.07	R-Auktion	2.14%	15'320	3'000
24.05.07	GG	1W	29.05.07	05.06.07	R-Auktion	2.14%	9'564	5'001
24.05.07	GG	Non-Std	29.05.07	04.06.07	R-Auktion	2.14%	3'624	2'000
25.05.07	GG	1W	30.05.07	06.06.07	R-Auktion	2.14%	4'500	3'700

\* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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