

**Kommunikation**

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

Zürich, 11. Juni 2007

## Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 8. Juni 2007

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

<b>Aktiven</b>	8. Juni 2007	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	19'790.0	-1'913.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	6.0	+6.0
<b>Passiven</b>		
Notenumlauf	38'648.1	-646.5
Girokonten inländischer Banken	4'519.8	-1'177.7
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
04.06.07	1.75% - 2.75%	2.47333%	4.15%
05.06.07	1.75% - 2.75%	2.47417%	4.10%
06.06.07	1.75% - 2.75%	2.47833%	3.91%
07.06.07	1.75% - 2.75%	2.48083%	3.80%
08.06.07	1.75% - 2.75%	2.47833%	4.19%

\* 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	01.06.07	5'786
04.05.07	5'223	08.06.07	5'748
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
04.06.07	2.10%	2.20%	1.80%	4'278	79
05.06.07	1.91%	2.09%	1.60%	2'744	52
06.06.07	1.80%	2.10%	1.00%	3'917	69
07.06.07	2.19%	2.25%	2.00%	4'196	65
08.06.07	2.20%	2.30%	2.00%	3'914	65

\* 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
04.06.07	GG	1W	06.06.07	13.06.07	R-Auktion	2.14%	18'954	4'002
05.06.07	GG	1W	07.06.07	14.06.07	R-Auktion	2.14%	8'960	4'000
06.06.07	GG	1W	08.06.07	15.06.07	R-Auktion	2.14%	1'788	1'788
07.06.07	GG	1W	11.06.07	18.06.07	R-Auktion	2.14%	19'025	7'000
08.06.07	GG	1W	12.06.07	19.06.07	R-Auktion	2.14%	28'048	5'001

\* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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