

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)

| Aktiven | 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 |
| Passiven | | |
| 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)