

**Kommunikation**

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

Zürich, 16. Juli 2007

## Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 13. Juli 2007

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

<b>Aktiven</b>	13. Juli 2007	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinstierungsgeschäften	20'103.0	-902.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
<b>Passiven</b>		
Notenumlauf	38'460.5	-728.2
Girokonten inländischer Banken	4'954.8	-164.2
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	0.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
09.07.07	2.00% - 3.00%	2.72000%	4.38%
10.07.07	2.00% - 3.00%	2.72167%	4.41%
11.07.07	2.00% - 3.00%	2.71083%	4.32%
12.07.07	2.00% - 3.00%	2.72000%	4.15%
13.07.07	2.00% - 3.00%	2.73583%	4.09%

\* 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
25.05.07	6'005	22.06.07	4'469
01.06.07	5'786	29.06.07	5'453
08.06.07	5'748	06.07.07	5'560
15.06.07	5'446	13.07.07	5'438
Schlusswert Periode	5'228		
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**
20.05.06 - 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%
20.04.07 - 19.05.07	8'729	10'110	4'910	5'200	116	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
09.07.07	2.41%	2.48%	2.05%	2'873	56
10.07.07	2.32%	2.45%	1.95%	3'585	68
11.07.07	2.15%	2.35%	1.75%	2'679	54
12.07.07	2.09%	2.35%	1.85%	2'658	53
13.07.07	2.15%	2.30%	1.95%	2'215	56

\* 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
09.07.07	GG	1W	11.07.07	18.07.07	R-Auktion	2.43%	59'453	3'000
10.07.07	GG	1W	12.07.07	19.07.07	R-Auktion	2.43%	83'256	3'003
11.07.07	GG	1W	13.07.07	20.07.07	R-Auktion	2.43%	23'442	4'100
12.07.07	GN	ON	12.07.07	13.07.07	R-Bilateral	1.93%	300	300
12.07.07	GG	1W	16.07.07	23.07.07	R-Auktion	2.43%	19'871	3'500
13.07.07	GG	1W	17.07.07	24.07.07	R-Auktion	2.43%	14'050	5'501

\* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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