

**Kommunikation**

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

Zürich, 24. September 2007

## Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 21. September 2007

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

<b>Aktiven</b>	21. September 2007	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	20'002.0	-1.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
<b>Passiven</b>		
Notenumlauf	37'648.6	-22.4
Girokonten inländischer Banken	5'025.2	-134.2
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	6.0	-253.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
17.09.07	2.25% - 3.25%	2.78000%	4.02%
18.09.07	2.25% - 3.25%	2.77833%	3.94%
19.09.07	2.25% - 3.25%	2.75667%	3.86%
20.09.07	2.25% - 3.25%	2.75000%	3.84%
21.09.07	2.25% - 3.25%	2.75000%	3.94%

\* 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
24.08.07	5'471	21.09.07	5'048
31.08.07	5'513		
07.09.07	5'534		
14.09.07	5'434		
Schlusswert Periode	5'284		

\* 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**
20.08.06 - 19.09.06	8'142	9'479	4'644	4'834	116	-
20.09.06 - 19.10.06	8'119	9'765	4'810	4'956	120	-
20.10.06 - 19.11.06	8'184	9'464	4'643	4'821	116	-
20.11.06 - 19.12.06	8'314	9'857	4'774	5'083	119	-
20.12.06 - 19.01.07	8'404	10'550	5'359	5'191	126	-
20.01.07 - 19.02.07	8'489	9'958	4'732	5'226	117	-
20.02.07 - 19.03.07	8'541	10'330	4'851	5'479	121	-
20.03.07 - 19.04.07	8'639	10'321	5'027	5'295	119	-
20.04.07 - 19.05.07	8'729	10'110	4'910	5'200	116	6.09%
20.05.07 - 19.06.07	8'725	10'081	4'854	5'227	116	6.05%
20.06.07 - 19.07.07	8'676	10'191	4'960	5'232	117	6.38%
20.07.07 - 19.08.07	8'650	10'131	4'782	5'349	117	6.31%

\* 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
17.09.07	1.94%	2.15%	1.60%	4'781	79
18.09.07	1.86%	2.10%	1.40%	3'838	74
19.09.07	1.84%	2.00%	1.25%	4'265	64
20.09.07	1.94%	2.10%	1.80%	4'398	75
21.09.07	1.88%	2.00%	1.80%	4'366	76

\* 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
17.09.07	GN	ON	17.09.07	18.09.07	R-Bilateral	1.83%	1'500	1'500
17.09.07	GG	1W	19.09.07	26.09.07	R-Auktion	2.08%	6'892	3'000
18.09.07	GN	ON	18.09.07	19.09.07	R-Bilateral	1.83%	1'265	1'265
18.09.07	GG	1W	20.09.07	27.09.07	R-Auktion	2.08%	4'472	3'001
19.09.07	GN	ON	19.09.07	20.09.07	R-Bilateral	1.83%	1'275	1'275
19.09.07	GG	1W	21.09.07	28.09.07	R-Auktion	2.08%	4'150	2'001
19.09.07	GG	SN	21.09.07	24.09.07	R-Auktion	2.08%	5'660	2'000
20.09.07	GG	1W	24.09.07	01.10.07	R-Auktion	2.08%	15'637	3'000
21.09.07	GN	ON	21.09.07	24.09.07	R-Bilateral	1.83%	6	6
21.09.07	GG	1W	25.09.07	02.10.07	R-Auktion	2.08%	17'511	4'501

\* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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