

**Kommunikation**

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

Zürich, 17. Dezember 2007

## Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 14. Dezember 2007

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

<b>Aktiven</b>	14. Dezember 2007	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	23'004.0	+598.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.1	+0.1
<b>Passiven</b>		
Notenumlauf	40'338.4	+168.5
Girokonten inländischer Banken	5'175.2	+230.8
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	10.0	+10.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
10.12.07	2.25% - 3.25%	2.76667%	4.01%
11.12.07	2.25% - 3.25%	2.78000%	3.99%
12.12.07	2.25% - 3.25%	2.79333%	3.95%
13.12.07	2.25% - 3.25%	2.80667%	3.84%
14.12.07	2.25% - 3.25%	2.78833%	3.88%

\* 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
26.10.07	5'037	23.11.07	5'653
02.11.07	4'936	30.11.07	5'607
09.11.07	5'073	07.12.07	5'497
16.11.07	5'177	14.12.07	5'379
Schlusswert Periode	5'260		

\* 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**
20.10.06 - 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%
20.08.07 - 19.09.07	8'654	10'069	4'786	5'283	116	6.10%
20.09.07 - 19.10.07	8'665	10'098	5'007	5'092	117	5.97%

\* 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
10.12.07	1.99%	2.08%	1.80%	5'481	87
11.12.07	1.95%	2.08%	1.50%	4'563	81
12.12.07	1.84%	2.05%	1.25%	5'631	96
13.12.07	1.88%	2.00%	1.70%	5'511	97
14.12.07	1.84%	1.95%	1.65%	5'929	95

\* 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
10.12.07	GG	1W	12.12.07	19.12.07	R-Auktion	2.05%	17'240	2'000
11.12.07	GG	1W	13.12.07	20.12.07	R-Auktion	2.05%	31'249	1'700
12.12.07	GN	ON	12.12.07	13.12.07	R-Bilateral	1.80%	2'701	2'701
12.12.07	GG	1W	14.12.07	21.12.07	R-Auktion	2.05%	35'183	3'700
13.12.07	GG	1M	17.12.07	17.01.08	R-Auktion	2.10%	29'736	6'701
13.12.07	GG	1W	17.12.07	24.12.07	R-Auktion	2.05%	6'950	2'500
14.12.07	GN	ON	14.12.07	17.12.07	R-Bilateral	1.80%	10	10
14.12.07	GG	3W	18.12.07	08.01.08	R-Auktion	2.10%	21'389	3'800

\* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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