

**Kommunikation**

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

Zürich, 24. Dezember 2007

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

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

<b>Aktiven</b>	21. Dezember 2007	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	26'007.0	+3'003.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.1	0.0
<b>Passiven</b>		
Notenumlauf	42'813.5	+2'475.1
Girokonten inländischer Banken	5'294.7	+119.5
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	655.0	+645.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
17.12.07	2.25% - 3.25%	2.78167%	3.84%
18.12.07	2.25% - 3.25%	2.78000%	3.83%
19.12.07	2.25% - 3.25%	2.77500%	3.80%
20.12.07	2.25% - 3.25%	2.77167%	3.81%
21.12.07	2.25% - 3.25%	2.76833%	3.84%

\* 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
23.11.07	5'653	21.12.07	5'755
30.11.07	5'607		
07.12.07	5'497		
14.12.07	5'379		
Schlusswert Periode	5'298		

\* 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
17.12.07	1.83%	1.90%	1.70%	6'176	95
18.12.07	1.80%	1.95%	1.25%	5'249	81
19.12.07	1.81%	1.90%	1.50%	5'152	90
20.12.07	1.84%	1.92%	1.70%	4'831	78
21.12.07	1.86%	2.03%	1.78%	3'364	66

\* 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
17.12.07	GN	ON	17.12.07	18.12.07	R-Bilateral	1.80%	1'800	1'800
17.12.07	GG	3W	19.12.07	09.01.08	R-Auktion	2.10%	15'221	2'002
18.12.07	GN	ON	18.12.07	19.12.07	R-Bilateral	1.80%	1'500	1'500
18.12.07	GG	1W	20.12.07	27.12.07	R-Auktion	2.05%	4'681	2'800
19.12.07	GG	1W	21.12.07	28.12.07	R-Auktion	2.05%	10'600	4'201
20.12.07	GG	1W	24.12.07	31.12.07	R-Auktion	2.05%	5'200	3'001
21.12.07	GN	ON	21.12.07	24.12.07	R-Bilateral	1.80%	655	655
21.12.07	GG	1W	27.12.07	03.01.08	R-Auktion	2.05%	27'782	3'001

\* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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