

Kommunikation

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

Zürich, 31. Dezember 2007

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 28. Dezember 2007

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

Aktiven	28. Dezember 2007	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	27'508.0	+1'501.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	-0.1
Passiven		
Notenumlauf	44'079.0	+1'265.5
Girokonten inländischer Banken	4'844.0	-450.7
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	619.0	-36.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
24.12.07	2.25% - 3.25%	2.78667%	3.86%
25.12.07	2.25% - 3.25%	-	-
26.12.07	2.25% - 3.25%	-	-
27.12.07	2.25% - 3.25%	2.79000%	3.85%
28.12.07	2.25% - 3.25%	2.76000%	3.90%

* 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	28.12.07	5'344
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**
20.11.06 - 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%
20.10.07 - 19.11.07	8'761	10'150	4'893	5'258	116	6.00%

* 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
24.12.07	1.85%	2.00%	1.80%	4'330	73
25.12.07	-	-	-	-	-
26.12.07	-	-	-	-	-
27.12.07	1.90%	2.03%	1.84%	6'950	107
28.12.07	1.84%	2.00%	1.72%	7'362	114

* 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
24.12.07	GN	ON	24.12.07	27.12.07	R-Bilateral	1.80%	738	738
24.12.07	GG	1W	28.12.07	04.01.08	R-Auktion	2.05%	31'750	5'000
25.12.07	-	-	-	-	-	-	-	-
26.12.07	-	-	-	-	-	-	-	-
27.12.07	GG	1W	31.12.07	07.01.08	R-Auktion	2.05%	12'590	3'001
27.12.07	GG	SN	31.12.07	03.01.08	R-Auktion	2.05%	9'000	3'500
28.12.07	GN	ON	28.12.07	31.12.07	R-Bilateral	1.80%	619	619
28.12.07	GG	1W	03.01.08	10.01.08	R-Auktion	2.05%	10'720	3'001

* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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