

**Kommunikation**

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

Zürich, 14. Januar 2008

## Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 11. Januar 2008

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

<b>Aktiven</b>	11. Januar 2008	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	23'805.0	-3'704.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
<b>Passiven</b>		
Notenumlauf	41'744.9	-1'952.5
Girokonten inländischer Banken	3'604.8	-2'221.9
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	800.0	+800.0

### Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
07.01.08	2.25% - 3.25%	2.76500%	3.91%
08.01.08	2.25% - 3.25%	2.75500%	3.88%
09.01.08	2.25% - 3.25%	2.75000%	3.97%
10.01.08	2.25% - 3.25%	2.74500%	3.86%
11.01.08	2.25% - 3.25%	2.73833%	3.83%

\* 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	04.01.08	5'983
14.12.07	5'379	11.01.08	5'595
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
07.01.08	1.88%	2.00%	1.80%	8'634	133
08.01.08	1.97%	2.12%	1.90%	7'912	123
09.01.08	1.86%	1.95%	1.50%	5'708	89
10.01.08	1.83%	1.98%	1.75%	6'130	96
11.01.08	1.81%	1.95%	1.50%	5'855	91

\* 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
07.01.08	GG	1W	09.01.08	16.01.08	R-Auktion	2.05%	12'603	2'001
08.01.08	GG	Non-Std	10.01.08	16.01.08	R-Auktion	2.05%	7'377	2'500
09.01.08	GN	ON	09.01.08	10.01.08	R-Bilateral	1.80%	1'300	1'300
09.01.08	GG	1W	11.01.08	18.01.08	R-Auktion	2.05%	7'785	4'001
10.01.08	GG	1W	14.01.08	21.01.08	R-Auktion	2.05%	2'544	2'544
11.01.08	GN	ON	11.01.08	14.01.08	R-Bilateral	1.80%	800	800
11.01.08	GG	1W	15.01.08	22.01.08	R-Auktion	2.05%	9'090	6'000

\* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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