

Kommunikation

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

Zürich, 28. Januar 2008

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 25. Januar 2008

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

Aktiven	25. Januar 2008	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	23'502.0	+1'957.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
Passiven		
Notenumlauf	39'889.6	-272.2
Girokonten inländischer Banken	5'965.7	+3'374.1
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	-925.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
21.01.08	2.25% - 3.25%	2.66833%	4.04%
22.01.08	2.25% - 3.25%	2.65500%	4.15%
23.01.08	2.25% - 3.25%	2.64333%	4.21%
24.01.08	2.25% - 3.25%	2.65000%	4.16%
25.01.08	2.25% - 3.25%	2.66333%	4.14%

* 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
21.12.07	5'755	25.01.08	4'226
28.12.07	5'344		
04.01.08	5'983		
11.01.08	5'595		
18.01.08	5'159		
Schlusswert Periode	5'076		

* 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**
20.12.06 - 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%
20.11.07 - 19.12.07	8'865	10'502	5'205	5'297	118	5.98%

* 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
21.01.08	2.15%	2.24%	2.05%	6'348	97
22.01.08	2.21%	2.30%	2.12%	6'740	107
23.01.08	2.16%	2.24%	2.00%	7'876	112
24.01.08	2.14%	2.25%	2.05%	7'205	109
25.01.08	2.08%	2.16%	1.90%	6'937	109

* 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
21.01.08	GG	1W	23.01.08	30.01.08	R-Auktion	2.16%	10'376	4'501
22.01.08	GG	1W	24.01.08	31.01.08	R-Auktion	2.17%	15'960	6'500
23.01.08	GG	1W	25.01.08	01.02.08	R-Auktion	2.18%	22'126	4'000
24.01.08	GG	1W	28.01.08	04.02.08	R-Auktion	2.19%	15'196	3'500
25.01.08	GG	1W	29.01.08	05.02.08	R-Auktion	2.20%	8'423	5'001

* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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