

Kommunikation

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

Zürich, 15. September 2008

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 12. September 2008

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

| Aktiven | 12. September 2008 | Veränderungen gegenüber Vorwoche |
|---|--------------------|-------------------------------------|
| Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften | 34'003.0 | -499.0 |
| Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität | 0.0 | 0.0 |
| Passiven | | |
| Notenumlauf | 39'524.1 | -440.8 |
| Girokonten inländischer Banken | 5'082.1 | -78.9 |
| Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften | 0.0 | 0.0 |

Referenzzinssätze SNB

| Datum | Zielband für Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor | Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität* |
|----------|----------------------------------|------------------|--|
| 08.09.08 | 2.25% - 3.25% | 2.73250% | 3.89% |
| 09.09.08 | 2.25% - 3.25% | 2.73167% | 3.88% |
| 10.09.08 | 2.25% - 3.25% | 2.73167% | 3.85% |
| 11.09.08 | 2.25% - 3.25% | 2.72833% | 3.92% |
| 12.09.08 | 2.25% - 3.25% | 2.73000% | 3.79% |

* 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 |
|--|--------------|--|--------------|
| 25.07.08 | 5'092 | 22.08.08 | 5'415 |
| 01.08.08 | 5'173 | 29.08.08 | 5'245 |
| 08.08.08 | 5'090 | 05.09.08 | 5'189 |
| 15.08.08 | 5'094 | 12.09.08 | 5'154 |
| Schlusswert Periode | 5'189 | | |

* 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** |
|---------------------|-------------|--------------------------|-----------------|-------------------|--------------------------|------------|
| 20.07.07 - 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% |
| 20.12.07 - 19.01.08 | 9'008 | 11'082 | 6'006 | 5'076 | 123 | 5.90% |
| 20.01.08 - 19.02.08 | 9'029 | 10'460 | 5'448 | 5'011 | 116 | 6.27% |
| 20.02.08 - 19.03.08 | 9'068 | 10'790 | 5'545 | 5'245 | 119 | 6.19% |
| 20.03.08 - 19.04.08 | 9'091 | 11'548 | 6'037 | 5'511 | 127 | 5.89% |
| 20.04.08 - 19.05.08 | 9'228 | 10'702 | 5'761 | 4'941 | 116 | 5.74% |
| 20.05.08 - 19.06.08 | 9'371 | 10'877 | 5'545 | 5'332 | 116 | 5.83% |
| 20.06.08 - 19.07.08 | 9'403 | 10'822 | 5'685 | 5'137 | 115 | 5.81% |

* 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 |
|----------|------------------------------|-------------|-------------|-----------------------------------|------------------|
| 08.09.08 | 1.88% | 1.95% | 1.75% | 5'652 | 97 |
| 09.09.08 | 1.85% | 1.93% | 1.65% | 5'328 | 86 |
| 10.09.08 | 1.92% | 1.97% | 1.80% | 8'225 | 119 |
| 11.09.08 | 1.79% | 1.93% | 1.50% | 4'377 | 75 |
| 12.09.08 | 1.78% | 2.05% | 1.25% | 5'185 | 86 |

* 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 |
|-----------|------|----------|----------|----------|-----------|---------|--------|-----------|
| 08.09.08 | GG | 1W | 10.09.08 | 17.09.08 | R-Auktion | 1.90% | 8'592 | 7'500 |
| 09.09.08 | GG | 1W | 11.09.08 | 18.09.08 | R-Auktion | 1.90% | 7'121 | 6'100 |
| 10.09.08 | GG | 1W | 12.09.08 | 19.09.08 | R-Auktion | 1.90% | 8'059 | 6'300 |
| 11.09.08 | GG | 1W | 15.09.08 | 22.09.08 | R-Auktion | 1.90% | 3'532 | 3'532 |
| 12.09.08 | GG | 1W | 16.09.08 | 23.09.08 | R-Auktion | 1.90% | 8'233 | 7'500 |

* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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