

Kommunikation

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

Zürich, 22. September 2008

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 19. September 2008

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

Aktiven	19. September 2008	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinstierungsgeschäften	39'536.0	+5'533.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
Passiven		
Notenumlauf	39'829.7	+305.6
Girokonten inländischer Banken	5'286.8	+204.7
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	4'000.0	+4'000.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
15.09.08	2.25% - 3.25%	2.71833%	3.78%
16.09.08	2.25% - 3.25%	2.73250%	3.97%
17.09.08	2.25% - 3.25%	2.75833%	3.88%
18.09.08	2.25% - 3.25%	2.78000%	3.68%
19.09.08	2.25% - 3.25%	2.79333%	3.67%

* 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
		19.09.08	5'096
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	Referenzzsatz (gewichtet)*	Tageshöchst	Tagestiefst	Handelsvolumen in Mio. Franken	Anzahl Geschäfte
15.09.08	1.97%	2.10%	1.55%	4'604	81
16.09.08	1.88%	2.25%	1.25%	5'799	74
17.09.08	1.68%	2.00%	1.50%	3'266	51
18.09.08	1.67%	2.15%	1.00%	7'525	107
19.09.08	1.64%	1.80%	1.00%	10'362	142

* 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
15.09.08	GN	ON	15.09.08	16.09.08	R-Bilateral	1.65%	2'500	2'500
15.09.08	GG	1W	17.09.08	24.09.08	R-Auktion	1.90%	26'080	8'501
15.09.08	GG	ON	15.09.08	16.09.08	R-Auktion	1.90%	7'789	5'000
15.09.08	GG	TN	16.09.08	17.09.08	R-Bilateral	2.15%	4'000	4'000
16.09.08	GN	ON	16.09.08	17.09.08	R-Bilateral	1.65%	9'070	9'070
16.09.08	GG	1W	18.09.08	25.09.08	R-Auktion	1.90%	38'027	9'001
16.09.08	GG	ON	16.09.08	17.09.08	R-Auktion	1.90%	11'060	5'001
16.09.08	GG	TN	17.09.08	18.09.08	R-Bilateral	2.15%	7'400	7'400
17.09.08	GN	ON	17.09.08	18.09.08	R-Bilateral	1.65%	8'000	8'000
17.09.08	GG	1W	19.09.08	26.09.08	R-Auktion	1.90%	37'808	8'000
17.09.08	GG	TN	18.09.08	19.09.08	R-Bilateral	2.15%	2'400	2'400
18.09.08	GN	ON	18.09.08	19.09.08	R-Bilateral	1.65%	5'800	5'800
18.09.08	GG	1W	22.09.08	29.09.08	R-Auktion	1.90%	25'495	6'000
19.09.08	GN	ON	19.09.08	22.09.08	R-Bilateral	1.65%	4'000	4'000
19.09.08	GG	1W	23.09.08	30.09.08	R-Auktion	1.90%	9'810	4'001
19.09.08	GG	Non-Std	23.09.08	13.01.09	R-Auktion	2.05%	5'733	3'002

* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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