

Kommunikation

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

Zürich, 29. September 2008

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 26. September 2008

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

Aktiven	26. September 2008	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinstierungsgeschäften	39'004.0	-532.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
Passiven		
Notenumlauf	40'532.6	+702.9
Girokonten inländischer Banken	5'057.1	-229.7
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	2'900.0	-1'100.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
22.09.08	2.25% - 3.25%	2.80000%	3.64%
23.09.08	2.25% - 3.25%	2.80833%	3.37%
24.09.08	2.25% - 3.25%	2.81667%	3.63%
25.09.08	2.25% - 3.25%	2.85000%	3.57%
26.09.08	2.25% - 3.25%	2.85500%	3.53%

* 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
22.08.08	5'415	26.09.08	5'942
29.08.08	5'245		
05.09.08	5'189		
12.09.08	5'154		
19.09.08	5'096		
Schlusswert Periode	5'096		

* 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**
20.08.07 - 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	9'373	10'877	5'545	5'332	116	5.83%
20.06.08 - 19.07.08	9'407	10'822	5'685	5'137	115	5.81%
20.07.08 - 19.08.08	9'295	10'858	5'675	5'183	117	5.87%

* 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
22.09.08	1.37%	1.80%	0.35%	7'119	100
23.09.08	1.63%	1.90%	0.75%	8'078	121
24.09.08	1.57%	1.70%	0.50%	9'409	128
25.09.08	1.53%	1.84%	0.50%	9'327	141
26.09.08	1.52%	1.75%	0.75%	6'615	107

* 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
22.09.08	GN	ON	22.09.08	23.09.08	R-Bilateral	1.65%	3'999	3'999
22.09.08	GG	1W	24.09.08	01.10.08	R-Auktion	1.90%	21'084	8'001
23.09.08	GN	ON	23.09.08	24.09.08	R-Bilateral	1.65%	670	670
23.09.08	GG	1W	25.09.08	02.10.08	R-Auktion	1.90%	19'537	8'500
24.09.08	GN	ON	24.09.08	25.09.08	R-Bilateral	1.65%	2'000	2'000
24.09.08	GG	1W	26.09.08	03.10.08	R-Auktion	1.90%	20'595	9'500
25.09.08	GN	ON	25.09.08	26.09.08	R-Bilateral	1.65%	800	800
25.09.08	GG	1W	29.09.08	06.10.08	R-Auktion	1.90%	22'030	7'000
26.09.08	GN	ON	26.09.08	29.09.08	R-Bilateral	1.60%	2'900	2'900
26.09.08	GG	1W	30.09.08	07.10.08	R-Auktion	1.85%	10'355	4'000
26.09.08	GG	Non-Std	30.09.08	20.01.09	R-Auktion	2.00%	8'635	3'000

* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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