

Kommunikation

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

Zürich, 6. Oktober 2008

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 3. Oktober 2008

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

Aktiven	3. Oktober 2008	Veränderungen gegenüber Vorwoche
Forderungen aus Hauptfinanzierungs- und Feinsteuergeschäften	41'450.0	+2'446.0
Forderungen aus der Engpassfinanzierungsfazität	0.0	0.0
Passiven		
Notenumlauf	41'929.6	+1'397.0
Girokonten inländischer Banken	9'340.0	+4'282.9
Verbindlichkeiten aus Abschöpfungsgeschäften	0.0	-2'900.0

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
29.09.08	2.25% - 3.25%	2.93000%	3.52%
30.09.08	2.25% - 3.25%	2.95500%	3.56%
01.10.08	2.25% - 3.25%	2.97750%	3.64%
02.10.08	2.25% - 3.25%	2.99500%	3.64%
03.10.08	2.25% - 3.25%	3.02167%	3.58%

* 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	03.10.08	6'406
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
29.09.08	1.56%	1.75%	0.25%	7'785	112
30.09.08	1.64%	2.00%	1.00%	7'780	113
01.10.08	1.64%	2.00%	1.40%	11'755	152
02.10.08	1.58%	1.95%	0.50%	10'614	157
03.10.08	1.33%	2.00%	0.01%	4'449	67

* 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
29.09.08	GN	ON	29.09.08	30.09.08	R-Bilateral	1.60%	3'191	3'191
29.09.08	GG	1W	01.10.08	08.10.08	R-Auktion	1.85%	12'365	5'000
30.09.08	GN	ON	30.09.08	01.10.08	R-Bilateral	2.00%	200	200
30.09.08	GG	ON	30.09.08	01.10.08	R-Bilateral	1.50%	2'572	2'572
30.09.08	GG	1W	02.10.08	09.10.08	R-Auktion	1.75%	13'425	7'000
30.09.08	GG	3M	02.10.08	05.01.09	R-Auktion	1.90%	6'171	3'003
01.10.08	GG	ON	01.10.08	02.10.08	R-Bilateral	1.95%	320	320
01.10.08	GN	ON	01.10.08	02.10.08	R-Bilateral	1.45%	2'500	2'500
01.10.08	GG	1W	03.10.08	10.10.08	R-Auktion	1.70%	14'930	6'001
02.10.08	GG	1W	06.10.08	13.10.08	R-Auktion	1.65%	16'610	8'000
03.10.08	GG	1W	07.10.08	14.10.08	R-Auktion	1.65%	16'681	10'001
03.10.08	GG	TN	06.10.08	07.10.08	R-Auktion	1.65%	11'424	6'000
03.10.08	GG	ON	03.10.08	06.10.08	R-Auktion	1.65%	3'444	3'444

* GG = Geldgeber CHF; GN = Geldnehmer CHF

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