

Kommunikation

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

Zürich, 5. Oktober 2009

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 2. Oktober 2009

Referenzzinssätze SNB

Datum	Zielband für Dreimonats-Libor	Dreimonats-Libor	Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität*
28.09.09	0.00% - 0.75%	0.29000%	0.53%
29.09.09	0.00% - 0.75%	0.28833%	0.53%
30.09.09	0.00% - 0.75%	0.28833%	0.53%
01.10.09	0.00% - 0.75%	0.28667%	0.52%
02.10.09	0.00% - 0.75%	0.28667%	0.52%

* SARON (Swiss Average Rate Overnight), 12.00 Uhr Fixing + 50 Basispunkte.

Swiss Average Rates*

Datum	SARON 12.00 Uhr Fixing	SARON Handelsschluss	SAR1W Handelsschluss	SAR1M Handelsschluss	SAR3M Handelsschluss
28.09.09	0.027%	0.024%	-	0.064%	0.093%
29.09.09	0.029%	0.026%	0.054%	0.063%	-
30.09.09	0.026%	0.024%	0.045%	0.055%	0.076%
01.10.09	0.021%	0.019%	0.042%	0.057%	0.087%
02.10.09	0.022%	0.020%	0.033%	0.059%	0.081%

* Die Swiss Average Rates sind volumengewichtete Durchschnittssätze, die auf abgeschlossenen Transaktionen und Referenzpreisen des jeweiligen Handelstages basieren. Die Berechnung der Referenzpreise stützt sich auf verfügbare Quotes im Orderbuch der elektronischen Handelsplattform der Eurex. Die Swiss Average Rates werden durch die SIX Swiss Exchange berechnet.

Giroguthaben inländischer Banken im Wochendurchschnitt

(in Mio. Franken)

Durchschnitt für die Woche zum 2. Oktober 2009

47'299

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode*

(in Mio. Franken)

vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben	laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis	Giroguthaben
21.08.09	60'493	25.09.09	44'592
28.08.09	58'491	02.10.09	46'049
04.09.09	57'902		
11.09.09	56'768		
18.09.09	55'022		
Schlusswert Periode	54'686		

* 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**
20.08.08 - 19.09.08	9'097	10'656	5'567	5'089	117	5.83%
20.09.08 - 19.10.08	8'984	14'043	6'433	7'610	156	5.24%
20.10.08 - 19.11.08	9'039	14'435	6'600	7'835	160	4.43%
20.11.08 - 19.12.08	9'162	31'164	6'559	24'605	340	4.05%
20.12.08 - 19.01.09	9'239	45'750	7'431	38'319	495	4.02%
20.01.09 - 19.02.09	9'096	52'506	6'403	46'103	577	4.03%
20.02.09 - 19.03.09	8'990	52'526	6'503	46'023	584	4.02%
20.03.09 - 19.04.09	8'937	74'472	6'515	67'957	833	4.02%
20.04.09 - 19.05.09	8'910	72'983	6'342	66'641	819	4.03%
20.05.09 - 19.06.09	8'917	66'421	5'841	60'580	745	4.02%
20.06.09 - 19.07.09	8'783	72'650	5'739	66'911	827	4.02%
20.07.09 - 19.08.09	8'855	68'344	5'886	62'458	772	4.02%

* Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben.

** Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.