

Kommunikation

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

Zürich, 27. September 2010

Geldpolitisch wichtige Daten für die Woche zum 24. September 2010

Referenzzinssätze SNB

(in Prozent)

| Datum | Zielband für Dreimonats-Libor | Dreimonats-Libor | Sondersatz Engpassfinanzierungsfazität* |
|----------|----------------------------------|------------------|--|
| 20.09.10 | 0.00 - 0.75 | 0.17667 | 0.57 |
| 21.09.10 | 0.00 - 0.75 | 0.17667 | 0.57 |
| 22.09.10 | 0.00 - 0.75 | 0.17500 | 0.57 |
| 23.09.10 | 0.00 - 0.75 | 0.17500 | 0.59 |
| 24.09.10 | 0.00 - 0.75 | 0.17500 | 0.58 |

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

Swiss Average Rates*

(in Prozent)

| Datum | SARON 12.00 Uhr Fixing | SARON Handelsschluss | SAR1W Handelsschluss | SAR1M Handelsschluss | SAR3M Handelsschluss |
|----------|---------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 20.09.10 | 0.068 | 0.057 | 0.117 | 0.178 | 0.189 |
| 21.09.10 | 0.069 | 0.057 | 0.146 | 0.200 | 0.225 |
| 22.09.10 | 0.071 | 0.062 | 0.143 | 0.179 | 0.236 |
| 23.09.10 | 0.086 | 0.085 | 0.157 | 0.206 | 0.234 |
| 24.09.10 | 0.082 | 0.058 | 0.147 | 0.209 | 0.245 |

* 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 24. September 2010

25 356

Mindestreserven: Giroguthaben inländischer Banken im Durchschnitt der Unterlegungsperiode*

(in Mio. Franken)

| Vergangene Unterlegungsperiode Durchschnitt bis | Giroguthaben | Laufende Unterlegungsperiode Durchschnitt bis | Giroguthaben |
|--|--------------|--|--------------|
| 20.08.10 | 45 972 | 24.09.10 | 24 231 |
| 27.08.10 | 37 047 | | |
| 03.09.10 | 33 111 | | |
| 10.09.10 | 30 855 | | |
| 17.09.10 | 30 200 | | |
| Schlusswert Periode | 30 069 | | |

* 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** in % |
|---------------------|-------------|--------------------------|-----------------|-------------------|--------------------------|--------------------|
| 20.08.09 - 19.09.09 | 8 889 | 60 246 | 5 571 | 54 674 | 678 | 4.02 |
| 20.09.09 - 19.10.09 | 8 970 | 53 275 | 5 635 | 47 640 | 594 | 4.02 |
| 20.10.09 - 19.11.09 | 8 884 | 49 361 | 5 655 | 43 706 | 556 | 4.03 |
| 20.11.09 - 19.12.09 | 8 894 | 49 091 | 5 711 | 43 380 | 552 | 4.03 |
| 20.12.09 - 19.01.10 | 8 963 | 46 945 | 6 421 | 40 525 | 524 | 4.03 |
| 20.01.10 - 19.02.10 | 9 010 | 43 653 | 5 775 | 37 878 | 484 | 4.02 |
| 20.02.10 - 19.03.10 | 9 067 | 49 483 | 5 849 | 43 634 | 546 | 4.03 |
| 20.03.10 - 19.04.10 | 9 153 | 55 434 | 6 121 | 49 314 | 606 | 4.02 |
| 20.04.10 - 19.05.10 | 9 254 | 66 883 | 5 833 | 61 050 | 723 | 4.02 |
| 20.05.10 - 19.06.10 | 9 412 | 85 203 | 6 082 | 79 121 | 905 | 4.02 |
| 20.06.10 - 19.07.10 | 9 759 | 64 450 | 5 785 | 58 665 | 660 | 4.05 |
| 20.07.10 - 19.08.10 | 9 945 | 53 731 | 5 600 | 48 132 | 540 | 4.05 |

* Summe aus Noten/Münzen und Giroguthaben.

** Zinspflicht bei Nichterfüllen des Mindestreserve-Erfordernisses.