

Communiqué de presse

Communication

Case postale, CH-8022 Zurich
 Téléphone +41 58 631 00 00
communications@snb.ch

Zurich, le 2 août 2016

Données importantes de politique monétaire pour la semaine se terminant le 29 juillet 2016

Taux d'intérêt de référence de la BNS

en pour-cent

Date	Marge de fluctuation du Libor à trois mois	Libor à trois mois ¹	Taux spécial appliqué à la facilité pour resser- rements de liquidités ²	Taux d'intérêt sur les avoirs en comptes de virement ³
25.07.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.75460	0.50	- 0.75
26.07.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.75260	0.50	- 0.75
27.07.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.74820	0.50	- 0.75
28.07.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.74820	0.50	- 0.75
29.07.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.74760	0.50	- 0.75

¹ London Interbank Offered Rate, calculé par la ICE Benchmark Administration Ltd. (IBA).

² SARON (Swiss Average Rate Overnight), fixing de 12h00 + 50 points de base. Le taux spécial est toujours d'au moins 0,50%.

³ Prélevé uniquement sur la part des avoirs en comptes de virement excédant un certain montant (montant exonéré).

Swiss Average Rates ⁴

en pour-cent

Date	SARON Fixing de 12h00	SARON Clôture du négoce	SAR1W Clôture du négoce	SAR1M Clôture du négoce	SAR3M Clôture du négoce
25.07.16	- 0.748	- 0.739	.	- 0.800	.
26.07.16	- 0.747	- 0.742	- 0.725	- 0.818	.
27.07.16	- 0.742	- 0.739	- 0.720	- 0.795	.
28.07.16	- 0.748	- 0.741	- 0.725	- 0.780	.
29.07.16	- 0.750	- 0.745	.	- 0.790	.

⁴ Les Swiss Average Rates sont des taux d'intérêt pondérés par le volume, qui se basent sur les transactions conclues et sur les prix de référence du jour de négoce concerné. Le calcul des prix de référence repose sur les quotes disponibles dans le carnet d'ordres de la plate-forme de négoce électronique de SIX Repo SA. Les Swiss Average Rates sont calculés par SIX Swiss Exchange.

Communiqué de presse

Moyenne des avoirs à vue en francs à la BNS, pour la semaine se terminant le 29 juillet 2016

en millions de francs

Avoirs en comptes de virement des banques en Suisse	435 006
Autres avoirs à vue en francs	76 368
Total des avoirs à vue en francs à la BNS	511 374

Réserves minimales: avoirs en comptes de virement des banques en Suisse, en moyenne de la période d'application⁵

en millions de francs

Période d'application précédente Moyenne jusqu'au	Avoirs en comptes de virement	Période d'application en cours Moyenne jusqu'au	Avoirs en comptes de virement
24.06.16	425 444	22.07.16	433 161
01.07.16	428 298	29.07.16	434 453
08.07.16	430 421		
15.07.16	431 573		
Moyenne de la période	431 835		

⁵ La période d'application s'étend du 20 d'un mois au 19 du mois suivant.

Réserves minimales: accomplissement de l'exigence au cours des 12 dernières périodes d'application

en millions de francs

Période	Montant requis	Actifs pouvant être pris en compte ⁶	Billets et pièces	Avoirs en comptes de virement	Accomplissement en %	Taux d'intérêt ⁷ en %
20.06.15 - 19.07.15	14 335	400 099	6 700	393 399	2 791	3.26
20.07.15 - 19.08.15	14 321	401 986	6 255	395 731	2 807	3.27
20.08.15 - 19.09.15	14 298	403 560	6 251	397 310	2 823	3.27
20.09.15 - 19.10.15	14 388	406 433	6 435	399 999	2 825	3.28
20.10.15 - 19.11.15	14 401	407 943	6 612	401 331	2 833	3.27
20.11.15 - 19.12.15	14 403	407 851	6 589	401 261	2 832	3.27
20.12.15 - 19.01.16	14 446	410 271	7 010	403 261	2 840	3.27
20.01.16 - 19.02.16	14 533	414 238	6 450	407 788	2 850	3.27
20.02.16 - 19.03.16	14 682	422 316	6 710	415 606	2 876	3.27
20.03.16 - 19.04.16	14 799	428 955	7 146	421 809	2 899	3.29
20.04.16 - 19.05.16	14 927	427 780	7 270	420 510	2 866	3.27
20.05.16 - 19.06.16	14 978	424 001	7 341	416 660	2 831	3.27

⁶ Somme des billets, pièces et avoirs en comptes de virement.

⁷ Pour le calcul de la pénalité applicable en cas de non-respect de l'exigence en matière de réserves minimales.