

Communication

Case postale, CH-8022 Zurich
Téléphone +41 44 631 31 11
Fax +41 44 631 39 10

Zurich, le 22 juin 2009

Données importantes de politique monétaire pour la semaine se terminant le 19 juin 2009

Taux d'intérêt de référence de la BNS

| Date | Marge de fluctuation du Libor à trois mois | Libor à trois mois | Taux spécial de la facilité pour resserrements de liquidités* |
|----------|---|--------------------|---|
| 15.06.09 | 0.00% - 0.75% | 0.39500% | 0.52% |
| 16.06.09 | 0.00% - 0.75% | 0.39500% | 0.52% |
| 17.06.09 | 0.00% - 0.75% | 0.39500% | 0.52% |
| 18.06.09 | 0.00% - 0.75% | 0.39500% | 0.52% |
| 19.06.09 | 0.00% - 0.75% | 0.39667% | 0.53% |

* Repo-Overnight-Index (BNS) de la veille + 0.5 point.

Repo-Overnight-Index (BNS)

| Date | Taux de référence (pondéré)* | Maximum de la journée | Minimum de la journée | Volume des opérations en millions de francs | Nombre d'opérations |
|----------|---------------------------------|--------------------------|--------------------------|---|------------------------|
| 15.06.09 | 0.02% | 0.04% | 0.02% | 5'417 | 65 |
| 16.06.09 | 0.02% | 0.04% | 0.02% | 5'107 | 65 |
| 17.06.09 | 0.02% | 0.06% | 0.02% | 4'684 | 61 |
| 18.06.09 | 0.03% | 0.05% | 0.02% | 4'335 | 63 |
| 19.06.09 | 0.02% | 0.10% | 0.02% | 4'630 | 62 |

* Le Repo-Overnight-Index (BNS) est la moyenne des taux d'intérêt sur les opérations "overnight-GC" que les banques commerciales ont conclues entre elles au moyen de la plate-forme de négoce Eurex Repo. La moyenne est pondérée par le volume des opérations. Seules les opérations portant sur des titres admis par la BNS dans ses pensions sont prises en considération. La BNS reprend des données établies par Eurex Zürich AG.

Avoirs en comptes de virement des banques en Suisse, en moyenne hebdomadaire

(en millions de francs)

Moyenne de la semaine se terminant le 19 juin 2009

58'691

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

(en millions de francs)

| Période d'application précédente | | Période d'application en cours | | |
|----------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|-------------------------------|--|
| Moyenne jusqu'au | Avoirs en comptes de virement | Moyenne jusqu'au | Avoirs en comptes de virement | |
| 24.04.09 | 73'476 | 22.05.09 | 63'190 | |
| 01.05.09 | 77'686 | 29.05.09 | 61'791 | |
| 08.05.09 | 73'429 | 05.06.09 | 62'236 | |
| 15.05.09 | 68'769 | 12.06.09 | 61'186 | |
| | | 19.06.09 | 60'623 | |
| Moyenne de la période | 66'666 | | | |

* 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* | Billets et pièces | Avoirs en comptes de virement | Accomplissement en % | Taux d'intérêt** |
|---------------------|----------------|-------------------------------------|-------------------|-------------------------------|----------------------|------------------|
| 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% |
| 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% |

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

** Pour le calcul de la pénalité à verser en cas de détention insuffisante de réserves minimales.