

Communication

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

Zurich, le 25 janvier 2010

Données importantes de politique monétaire pour la semaine se terminant le 22 janvier 2010

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*
18.01.10	0.00% - 0.75%	0.25000%	0.54%
19.01.10	0.00% - 0.75%	0.25000%	0.53%
20.01.10	0.00% - 0.75%	0.25000%	0.53%
21.01.10	0.00% - 0.75%	0.25000%	0.53%
22.01.10	0.00% - 0.75%	0.25000%	0.53%

* Jusqu'au 24.08.2009: Repo-Overnight-Index (BNS) de la veille + 50 points de base. A partir du 25.08.2009: SARON (Swiss Average Rate Overnight), fixing de 12h00 + 50 points de base.

Swiss Average Rates*

Date	SARON Fixing de 12h00	SARON Clôture du négoce	SAR1W Clôture du négoce	SAR1M Clôture du négoce	SAR3M Clôture du négoce
18.01.10	0.035%	0.032%	0.047%	0.066%	0.094%
19.01.10	0.034%	0.033%	0.045%	0.062%	0.079%
20.01.10	0.034%	0.031%	0.048%	0.067%	0.071%
21.01.10	0.028%	0.023%	0.040%	0.065%	0.099%
22.01.10	0.027%	0.022%	0.044%	0.064%	0.090%

* 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 électronique de négoce d'Eurex. Les Swiss Average Rates sont calculés par SIX Swiss Exchange.

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

(en millions de francs)

Moyenne de la semaine se terminant le 22 janvier 2010

37'657

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
25.12.09	39'970	22.01.10	37'115
01.01.10	40'666		
08.01.10	41'220		
15.01.10	40'917		
Moyenne de la période	40'548		

* 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**
20.12.08 - 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%
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%

* 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.