

Communication

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

Zurich, le 4 octobre 2010

Données importantes de politique monétaire pour la semaine se terminant le 1er octobre 2010

Taux d'intérêt de référence de la BNS (en pour-cent)

Date	Marge de fluctuation du Libor à trois mois	Libor à trois mois	Taux spécial de la facilité pour resserrements de liquidités*
27.09.10	0.00 - 0.75	0.17500	0.56
28.09.10	0.00 - 0.75	0.17500	0.56
29.09.10	0.00 - 0.75	0.17833	0.56
30.09.10	0.00 - 0.75	0.17833	0.65
01.10.10	0.00 - 0.75	0.18000	0.58

* SARON (Swiss Average Rate Overnight), fixing de 12h00 + 50 points de base.

Swiss Average Rates* (en pour-cent)

Date	SARON Fixing de 12h00	SARON Clôture du négoce	SAR1W Clôture du négoce	SAR1M Clôture du négoce	SAR3M Clôture du négoce
27.09.10	0.057	0.045	0.141	0.180	0.200
28.09.10	0.061	0.053	0.163	0.200	0.196
29.09.10	0.059	0.049	0.145	0.234	0.260
30.09.10	0.150	0.094	0.140	0.178	0.217
01.10.10	0.079	0.068	0.130	0.225	0.280

* 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 1er octobre 2010

30 126

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

(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
20.08.10	45 972	24.09.10	24 231
27.08.10	37 047	01.10.10	27 670
03.09.10	33 111		
10.09.10	30 855		
17.09.10	30 200		
Moyenne de la période	30 069		

* 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 pou- vant être pris en compte*	Billets et pièces	Avoirs en comptes de virement	Accompli- sissement en %	Taux d'intérêt** en %
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

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

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