

Communication

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

Zurich, le 17 octobre 2011

Données importantes de politique monétaire pour la semaine se terminant le 14 octobre 2011

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 resserments de liquidités*
10.10.11	0.00 - 0.25	0.03000	0.51
11.10.11	0.00 - 0.25	0.03167	0.50
12.10.11	0.00 - 0.25	0.03500	0.50
13.10.11	0.00 - 0.25	0.03667	0.50
14.10.11	0.00 - 0.25	0.04000	0.50

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

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
10.10.11	0.005	0.007	- 0.050	- 0.045	0.013
11.10.11	- 0.024	- 0.023	- 0.004	0.007	- 0.127
12.10.11	0.002	0.005	- 0.050	- 0.020	- 0.095
13.10.11	- 0.004	- 0.015	- 0.050	0.002	- 0.039
14.10.11	- 0.002	- 0.008	- 0.038	- 0.030	- 0.069

* 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.

Moyenne des avoirs à vue en francs à la BNS, pour la semaine se terminant le 14 octobre 2011

(en millions de francs)

Avoirs en comptes de virement des banques en Suisse	195 553
Autres avoirs à vue en francs	39 627
Total des avoirs à vue en francs à la BNS	235 179

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
26.08.11	163 906	23.09.11	204 000
02.09.11	177 757	30.09.11	201 754
09.09.11	187 731	07.10.11	200 453
16.09.11	192 244	14.10.11	199 081
Moyenne de la période	193 248		

* 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** en %
20.08.10 - 19.09.10	9 998	35 624	5 560	30 064	356	4.08
20.09.10 - 19.10.10	9 740	36 092	5 550	30 542	371	4.05
20.10.10 - 19.11.10	9 760	31 339	5 493	25 846	321	4.05
20.11.10 - 19.12.10	9 799	28 585	5 829	22 756	292	4.07
20.12.10 - 19.01.11	9 806	35 291	6 184	29 107	360	4.05
20.01.11 - 19.02.11	9 750	33 412	5 773	27 639	343	4.03
20.02.11 - 19.03.11	9 713	30 295	5 590	24 705	312	4.03
20.03.11 - 19.04.11	9 797	29 647	5 636	24 011	303	4.03
20.04.11 - 19.05.11	9 897	30 063	5 702	24 361	304	4.03
20.05.11 - 19.06.11	10 009	31 441	5 717	25 723	314	4.03
20.06.11 - 19.07.11	10 045	33 116	5 626	27 490	330	4.03
20.07.11 - 19.08.11	10 088	61 779	5 611	56 168	612	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.