

Communication

Case postale, CH-8022 Zurich
 Téléphone +41 44 631 31 11
 communications@snb.ch

Zurich, le 6 août 2012

**Données importantes de politique monétaire
 pour la semaine se terminant le 3 août 2012**

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** |
|----------|---|---------------------|---|
| 30.07.12 | 0.00 - 0.25 | 0.06400 | 0.52 |
| 31.07.12 | 0.00 - 0.25 | 0.06000 | 0.50 |
| 01.08.12 | 0.00 - 0.25 | 0.05600 | . |
| 02.08.12 | 0.00 - 0.25 | 0.05600 | 0.50 |
| 03.08.12 | 0.00 - 0.25 | 0.05400 | 0.51 |

* London Interbank Offered Rate, calculé par la British Bankers' Association.

** 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 |
|----------|--------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 30.07.12 | 0.023 | - 0.011 | - 0.017 | - 0.085 | - 0.280 |
| 31.07.12 | - 0.054 | - 0.058 | - 0.022 | - 0.120 | - 0.190 |
| 01.08.12 | . | . | . | . | . |
| 02.08.12 | - 0.121 | - 0.085 | - 0.027 | - 0.141 | - 0.250 |
| 03.08.12 | 0.007 | - 0.030 | - 0.040 | - 0.084 | - 0.050 |

* 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 3 août 2012

(en millions de francs)

| | |
|---|----------------|
| Avoirs en comptes de virement des banques en Suisse | 277 299 |
| Autres avoirs à vue en francs | 74 756 |
| Total des avoirs à vue en francs à la BNS | 352 055 |

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 Moyenne jusqu'au | Avoirs en comptes de virement | Période d'application en cours Moyenne jusqu'au | Avoirs en comptes de virement |
|--|----------------------------------|--|----------------------------------|
| 22.06.12 | 233 697 | 20.07.12 | 266 535 |
| 29.06.12 | 236 594 | 27.07.12 | 270 374 |
| 06.07.12 | 240 122 | 03.08.12 | 273 606 |
| 13.07.12 | 242 793 | | |
| Moyenne de la période | 246 343 | | |

* 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- ssement en % | Taux d'intérêt** en % |
|---------------------|-------------------|---|----------------------|-------------------------------------|------------------------------|-----------------------------|
| 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 |
| 20.08.11 - 19.09.11 | 10 301 | 198 847 | 5 614 | 193 233 | 1 930 | 4.00 |
| 20.09.11 - 19.10.11 | 10 615 | 203 039 | 5 825 | 197 215 | 1 913 | 4.00 |
| 20.10.11 - 19.11.11 | 11 278 | 195 683 | 5 857 | 189 826 | 1 735 | 4.00 |
| 20.11.11 - 19.12.11 | 11 745 | 184 513 | 5 828 | 178 685 | 1 571 | 4.02 |
| 20.12.11 - 19.01.12 | 11 755 | 183 298 | 6 181 | 177 117 | 1 559 | 4.01 |
| 20.01.12 - 19.02.12 | 11 577 | 175 100 | 5 635 | 169 466 | 1 512 | 4.00 |
| 20.02.12 - 19.03.12 | 11 350 | 167 709 | 5 679 | 162 030 | 1 478 | 4.00 |
| 20.03.12 - 19.04.12 | 11 136 | 166 092 | 5 909 | 160 183 | 1 492 | 4.00 |
| 20.04.12 - 19.05.12 | 11 188 | 160 916 | 5 820 | 155 096 | 1 438 | 4.00 |
| 20.05.12 - 19.06.12 | 11 265 | 201 659 | 5 809 | 195 851 | 1 790 | 4.01 |

* 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.