

Communication

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

Zurich, le 1er octobre 2012

Données importantes de politique monétaire pour la semaine se terminant le 28 septembre 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**
24.09.12	0.00 - 0.25	0.04500	0.53
25.09.12	0.00 - 0.25	0.04500	0.52
26.09.12	0.00 - 0.25	0.04400	0.51
27.09.12	0.00 - 0.25	0.04400	0.50
28.09.12	0.00 - 0.25	0.04400	0.52

* 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
24.09.12	0.029	0.029	- 0.059	- 0.105	.
25.09.12	0.020	0.014	- 0.012	- 0.107	- 0.127
26.09.12	0.012	0.012	- 0.062	- 0.114	- 0.107
27.09.12	.	0.010	- 0.060	- 0.105	.
28.09.12	0.021	0.023	- 0.050	- 0.126	.

* 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 28 septembre 2012
 (en millions de francs)

Avoirs en comptes de virement des banques en Suisse	291 245
Autres avoirs à vue en francs	82 171
Total des avoirs à vue en francs à la BNS	373 416

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
24.08.12	286 830	21.09.12	292 252
31.08.12	288 072	28.09.12	291 469
07.09.12	289 193		
14.09.12	290 528		
Moyenne de la période	290 818		

* 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 %
20.08.11 - 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
20.06.12 - 19.07.12	11 707	252 036	5 837	246 199	2 153	4.00
20.07.12 - 19.08.12	11 988	282 432	5 827	276 605	2 356	3.98

* 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.