

Communiqué de presse

Communication

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

Zurich, le 6 octobre 2014

Données importantes de politique monétaire pour la semaine se terminant le 3 octobre 2014

Taux d'intérêt de référence de la BNS

en pour-cent

Date	Marge de fluctuation du Libor à trois mois	Libor à trois mois ¹	Taux spécial de la facilité pour resserments de liquidités ²
29.09.14	0.00 - 0.25	0.00600	0.50
30.09.14	0.00 - 0.25	0.00600	0.50
01.10.14	0.00 - 0.25	0.00300	0.50
02.10.14	0.00 - 0.25	0.00300	0.50
03.10.14	0.00 - 0.25	0.00300	0.50

¹ London Interbank Offered Rate, calculé par la ICE Benchmark Administration Ltd. (IBA).

² 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 ³

en pour-cent

Date	SARON Fixing de 12h00	SARON Clôture du négoce	SAR1W Clôture du négoce	SAR1M Clôture du négoce	SAR3M Clôture du négoce
29.09.14	- 0.011	- 0.009	- 0.051	.	.
30.09.14	0.010	0.012	- 0.026	—	.
01.10.14	- 0.009	- 0.005	- 0.046	- 0.010	.
02.10.14	- 0.011	- 0.010	- 0.035	—	.
03.10.14	- 0.011	- 0.011	- 0.057	—	.

³ 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 de négoce électronique de SIX Repo SA. Les Swiss Average Rates sont calculés par SIX Swiss Exchange.

Communiqué de presse

Moyenne des avoirs à vue en francs à la BNS, pour la semaine se terminant le 3 octobre 2014

en millions de francs

Avoirs en comptes de virement des banques en Suisse	310 399
Autres avoirs à vue en francs	57 106
Total des avoirs à vue en francs à la BNS	367 504

Réserves minimales: avoirs en comptes de virement des banques en Suisse, en moyenne de la période d'application ⁴

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
22.08.14	313 592	26.09.14	310 085
29.08.14	314 081	03.10.14	310 242
05.09.14	313 714		
12.09.14	313 015		
19.09.14	312 550		
Moyenne de la période	312 550		

⁴ 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 ⁵	Billets et pièces	Avoirs en comptes de virement	Accomplissement en %	Taux d'intérêt ⁶ en %
20.08.13 - 19.09.13	14 747	325 983	7 024	318 959	2 210	3.99
20.09.13 - 19.10.13	14 651	326 618	6 997	319 621	2 229	3.99
20.10.13 - 19.11.13	14 640	324 740	6 573	318 167	2 218	3.98
20.11.13 - 19.12.13	14 673	324 498	6 802	317 696	2 212	3.98
20.12.13 - 19.01.14	14 677	327 081	7 750	319 331	2 229	3.99
20.01.14 - 19.02.14	14 789	324 008	6 650	317 357	2 191	3.98
20.02.14 - 19.03.14	14 818	321 200	6 452	314 748	2 168	3.98
20.03.14 - 19.04.14	14 822	321 696	6 492	315 204	2 170	3.98
20.04.14 - 19.05.14	14 765	315 194	6 588	308 606	2 135	3.99
20.05.14 - 19.06.14	14 824	308 992	6 603	302 388	2 084	3.98
20.06.14 - 19.07.14	14 734	310 896	6 533	304 364	2 110	3.97
20.07.14 - 19.08.14	14 636	317 628	6 354	311 274	2 170	3.97

⁵ Somme des billets, pièces et avoirs en comptes de virement.

⁶ Pour le calcul de la pénalité à verser en cas de détention insuffisante de réserves minimales.