

Communiqué de presse

Communication

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

Zurich, le 29 décembre 2014

Données importantes de politique monétaire pour la semaine se terminant le 26 décembre 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 |
|----------|---|---------------------------------|--|
| 22.12.14 | -0.75 - 0.25 | - 0.05500 | 0.50 |
| 23.12.14 | -0.75 - 0.25 | - 0.06600 | 0.50 |
| 24.12.14 | -0.75 - 0.25 | - 0.06100 | 0.50 |
| 25.12.14 | -0.75 - 0.25 | . | . |
| 26.12.14 | -0.75 - 0.25 | . | . |

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 |
|----------|--------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 22.12.14 | - 0.002 | - 0.006 | 0.017 | 0.020 | . |
| 23.12.14 | - 0.001 | - 0.009 | 0.030 | . | . |
| 24.12.14 | - 0.013 | - 0.006 | . | 0.020 | . |
| 25.12.14 | . | . | . | . | . |
| 26.12.14 | . | . | . | . | . |

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 26 décembre 2014

en millions de francs

| | |
|---|----------------|
| Avoirs en comptes de virement des banques en Suisse | 326 891 |
| Autres avoirs à vue en francs | 59 924 |
| Total des avoirs à vue en francs à la BNS | 386 816 |

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 |
|--|-------------------------------|--|-------------------------------|
| 21.11.14 | 321 476 | 26.12.14 | 326 891 |
| 28.11.14 | 319 631 | | |
| 05.12.14 | 317 473 | | |
| 12.12.14 | 316 117 | | |
| 19.12.14 | 316 121 | | |
| Moyenne de la période | 316 121 | | |

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 % |
|---------------------|----------------|---|-------------------|-------------------------------|----------------------|----------------------------------|
| 20.11.13 - 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 | 14 635 | 317 628 | 6 354 | 311 274 | 2 170 | 3.97 |
| 20.08.14 - 19.09.14 | 14 568 | 318 987 | 6 321 | 312 666 | 2 190 | 4.00 |
| 20.09.14 - 19.10.14 | 14 587 | 318 499 | 6 574 | 311 925 | 2 183 | 4.00 |
| 20.10.14 - 19.11.14 | 14 655 | 320 037 | 6 455 | 313 582 | 2 184 | 3.99 |

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.