

Communiqué de presse

Communication

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

Zurich, le 1er juin 2015

Données importantes de politique monétaire pour la semaine se terminant le 29 mai 2015

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 appliqué à la facilité pour resser- rements de liquidités ² | Taux d'intérêt sur les avoirs en comptes de virement ³ |
|----------|---|---------------------------------|---|---|
| 25.05.15 | - 1.25 - - 0.25 | . | . | - 0.75 |
| 26.05.15 | - 1.25 - - 0.25 | - 0.78800 | 0.50 | - 0.75 |
| 27.05.15 | - 1.25 - - 0.25 | - 0.78800 | 0.50 | - 0.75 |
| 28.05.15 | - 1.25 - - 0.25 | - 0.78800 | 0.50 | - 0.75 |
| 29.05.15 | - 1.25 - - 0.25 | - 0.78800 | 0.50 | - 0.75 |

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%.

³ Prélevé uniquement sur la part des avoirs en comptes de virement excédant un certain montant (montant exonéré).

Swiss Average Rates ⁴

en pour-cent

| Date | SARON Fixing de 12h00 | SARON Clôture du négoce | SAR1W Clôture du négoce | SAR1M Clôture du négoce | SAR3M Clôture du négoce |
|----------|--------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 25.05.15 | . | . | . | . | . |
| 26.05.15 | - 0.727 | - 0.733 | - 0.795 | - 0.814 | - 0.837 |
| 27.05.15 | - 0.728 | - 0.728 | - 0.756 | - 0.807 | . |
| 28.05.15 | - 0.730 | - 0.731 | - 0.778 | - 0.796 | . |
| 29.05.15 | - 0.728 | - 0.726 | - 0.774 | . | - 0.800 |

⁴ 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 29 mai 2015

en millions de francs

| | |
|---|----------------|
| Avoirs en comptes de virement des banques en Suisse | 380 536 |
| Autres avoirs à vue en francs | 73 504 |
| Total des avoirs à vue en francs à la BNS | 454 040 |

Réserves minimales: avoirs en comptes de virement des banques en Suisse, en moyenne de la période d'application ⁵

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 |
|--|-------------------------------|--|-------------------------------|
| 24.04.15 | 384 876 | 22.05.15 | 381 367 |
| 01.05.15 | 384 450 | 29.05.15 | 380 786 |
| 08.05.15 | 382 576 | | |
| 15.05.15 | 381 138 | | |
| Moyenne de la période | 380 873 | | |

⁵ 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 ⁶ | Billets et pièces | Avoirs en comptes de virement | Accomplissement en % | Taux d'intérêt ⁷ en % |
|---------------------|----------------|---|-------------------|-------------------------------|----------------------|----------------------------------|
| 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 |
| 20.11.14 - 19.12.14 | 14 600 | 322 699 | 6 675 | 316 024 | 2 210 | 4.00 |
| 20.12.14 - 19.01.15 | 14 590 | 339 878 | 7 472 | 332 407 | 2 330 | 3.99 |
| 20.01.15 - 19.02.15 | 14 531 | 389 974 | 6 724 | 383 250 | 2 684 | 3.21 |
| 20.02.15 - 19.03.15 | 14 718 | 386 146 | 6 632 | 379 514 | 2 624 | 3.28 |
| 20.03.15 - 19.04.15 | 14 769 | 386 876 | 6 784 | 380 091 | 2 619 | 3.30 |

⁶ Somme des billets, pièces et avoirs en comptes de virement.

⁷ Pour le calcul de la pénalité applicable en cas de non-respect de l'exigence en matière de réserves minimales.