

## Communiqué de presse

### Communication

Case postale, CH-8022 Zurich  
 Téléphone +41 58 631 00 00  
[communications@snb.ch](mailto:communications@snb.ch)

Zurich, le 5 octobre 2015

## Données importantes de politique monétaire pour la semaine se terminant le 2 octobre 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 <sup>1</sup>	Taux spécial appliqué à la facilité pour resser- rements de liquidités <sup>2</sup>	Taux d'intérêt sur les avoirs en comptes de virement <sup>3</sup>
28.09.15	- 1.25 - - 0.25	- 0.72700	0.50	- 0.75
29.09.15	- 1.25 - - 0.25	- 0.73300	0.50	- 0.75
30.09.15	- 1.25 - - 0.25	- 0.73300	0.50	- 0.75
01.10.15	- 1.25 - - 0.25	- 0.73300	0.50	- 0.75
02.10.15	- 1.25 - - 0.25	- 0.73100	0.50	- 0.75

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

<sup>2</sup> SARON (Swiss Average Rate Overnight), fixing de 12h00 + 50 points de base. Le taux spécial est toujours d'au moins 0,50%.

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

### Swiss Average Rates <sup>4</sup>

en pour-cent

Date	SARON Fixing de 12h00	SARON Clôture du négoce	SAR1W Clôture du négoce	SAR1M Clôture du négoce	SAR3M Clôture du négoce
28.09.15	- 0.724	- 0.722	- 0.727	- 0.764	.
29.09.15	- 0.727	- 0.720	- 0.727	- 0.748	- 0.749
30.09.15	- 0.723	- 0.720	- 0.733	- 0.764	.
01.10.15	- 0.730	- 0.723	- 0.723	- 0.766	.
02.10.15	- 0.720	- 0.722	.	- 0.755	.

<sup>4</sup> 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 2 octobre 2015

en millions de francs

Avoirs en comptes de virement des banques en Suisse	399 162
Autres avoirs à vue en francs	66 140
<b>Total des avoirs à vue en francs à la BNS</b>	<b>465 303</b>

## Réserves minimales: avoirs en comptes de virement des banques en Suisse, en moyenne de la période d'application<sup>5</sup>

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
21.08.15	395 100	25.09.15	404 559
28.08.15	395 828	02.10.15	401 653
04.09.15	395 494		
11.09.15	396 330		
18.09.15	397 703		
Moyenne de la période	398 043		

<sup>5</sup> 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 <sup>6</sup>	Billets et pièces	Avoirs en comptes de virement	Accomplissement en %	Taux d'intérêt <sup>7</sup> en %
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	14 530	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	2 620	3.30
20.04.15 - 19.05.15	14 782	387 619	6 813	380 806	2 622	3.27
20.05.15 - 19.06.15	14 538	389 634	6 777	382 858	2 680	3.28
20.06.15 - 19.07.15	14 331	400 099	6 700	393 399	2 792	3.26
20.07.15 - 19.08.15	14 317	401 986	6 255	395 731	2 808	3.27

<sup>6</sup> Somme des billets, pièces et avoirs en comptes de virement.

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