

Communiqué de presse

Communication

Case postale, CH-8022 Zurich
 Téléphone +41 58 631 00 00
communications@snb.ch

Zurich, le 2 août 2016

Données importantes de politique monétaire pour la semaine se terminant le 29 juillet 2016

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 |
|----------|---|---------------------------------|---|---|
| 25.07.16 | - 1.25 - - 0.25 | - 0.75460 | 0.50 | - 0.75 |
| 26.07.16 | - 1.25 - - 0.25 | - 0.75260 | 0.50 | - 0.75 |
| 27.07.16 | - 1.25 - - 0.25 | - 0.74820 | 0.50 | - 0.75 |
| 28.07.16 | - 1.25 - - 0.25 | - 0.74820 | 0.50 | - 0.75 |
| 29.07.16 | - 1.25 - - 0.25 | - 0.74760 | 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 |
|----------|--------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 25.07.16 | - 0.748 | - 0.739 | . | - 0.800 | . |
| 26.07.16 | - 0.747 | - 0.742 | - 0.725 | - 0.818 | . |
| 27.07.16 | - 0.742 | - 0.739 | - 0.720 | - 0.795 | . |
| 28.07.16 | - 0.748 | - 0.741 | - 0.725 | - 0.780 | . |
| 29.07.16 | - 0.750 | - 0.745 | . | - 0.790 | . |

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 juillet 2016

en millions de francs

| | |
|---|----------------|
| Avoirs en comptes de virement des banques en Suisse | 435 006 |
| Autres avoirs à vue en francs | 76 368 |
| Total des avoirs à vue en francs à la BNS | 511 374 |

Réserves minimales: avoirs en comptes de virement des banques en Suisse, en moyenne de la période d'application⁵

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 |
|--|-------------------------------|--|-------------------------------|
| 24.06.16 | 425 444 | 22.07.16 | 433 161 |
| 01.07.16 | 428 298 | 29.07.16 | 434 453 |
| 08.07.16 | 430 421 | | |
| 15.07.16 | 431 573 | | |
| Moyenne de la période | 431 835 | | |

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 % |
|---------------------|----------------|---|-------------------|-------------------------------|----------------------|----------------------------------|
| 20.06.15 - 19.07.15 | 14 335 | 400 099 | 6 700 | 393 399 | 2 791 | 3.26 |
| 20.07.15 - 19.08.15 | 14 321 | 401 986 | 6 255 | 395 731 | 2 807 | 3.27 |
| 20.08.15 - 19.09.15 | 14 298 | 403 560 | 6 251 | 397 310 | 2 823 | 3.27 |
| 20.09.15 - 19.10.15 | 14 388 | 406 433 | 6 435 | 399 999 | 2 825 | 3.28 |
| 20.10.15 - 19.11.15 | 14 401 | 407 943 | 6 612 | 401 331 | 2 833 | 3.27 |
| 20.11.15 - 19.12.15 | 14 403 | 407 851 | 6 589 | 401 261 | 2 832 | 3.27 |
| 20.12.15 - 19.01.16 | 14 446 | 410 271 | 7 010 | 403 261 | 2 840 | 3.27 |
| 20.01.16 - 19.02.16 | 14 533 | 414 238 | 6 450 | 407 788 | 2 850 | 3.27 |
| 20.02.16 - 19.03.16 | 14 682 | 422 316 | 6 710 | 415 606 | 2 876 | 3.27 |
| 20.03.16 - 19.04.16 | 14 799 | 428 955 | 7 146 | 421 809 | 2 899 | 3.29 |
| 20.04.16 - 19.05.16 | 14 927 | 427 780 | 7 270 | 420 510 | 2 866 | 3.27 |
| 20.05.16 - 19.06.16 | 14 978 | 424 001 | 7 341 | 416 660 | 2 831 | 3.27 |

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.