

Communiqué de presse

Communication

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

Zurich, le 24 octobre 2016

Données importantes de politique monétaire pour la semaine se terminant le 21 octobre 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
17.10.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.72820	0.50	- 0.75
18.10.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.72880	0.50	- 0.75
19.10.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.72260	0.50	- 0.75
20.10.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.72400	0.50	- 0.75
21.10.16	- 1.25 - - 0.25	- 0.72400	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
17.10.16	- 0.738	- 0.740	- 0.738	- 0.793	.
18.10.16	- 0.739	- 0.737	- 0.746	- 0.799	.
19.10.16	- 0.734	- 0.735	- 0.742	- 0.800	.
20.10.16	- 0.736	- 0.735	- 0.730	- 0.800	.
21.10.16	- 0.736	- 0.734	- 0.747	.	- 0.750

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 21 octobre 2016

en millions de francs

Avoirs en comptes de virement des banques en Suisse	451 255
Autres avoirs à vue en francs	67 235
Total des avoirs à vue en francs à la BNS	518 490

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
23.09.16	447 226	21.10.16	449 581
30.09.16	450 850		
07.10.16	451 276		
14.10.16	451 304		
Moyenne de la période	451 407		

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 %
20.09.15 - 19.10.15	14 387	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	401 262	2 832	3.27
20.12.15 - 19.01.16	14 445	410 271	7 010	403 261	2 840	3.27
20.01.16 - 19.02.16	14 532	414 238	6 450	407 788	2 851	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	14 798	428 956	7 146	421 809	2 899	3.29
20.04.16 - 19.05.16	14 926	427 781	7 270	420 511	2 866	3.27
20.05.16 - 19.06.16	14 976	424 001	7 341	416 660	2 831	3.27
20.06.16 - 19.07.16	15 053	437 486	6 758	430 728	2 906	3.25
20.07.16 - 19.08.16	15 184	441 326	6 683	434 643	2 906	3.26
20.08.16 - 19.09.16	15 266	444 472	6 537	437 936	2 912	3.26

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.