

Communication

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

Zurich, le 15 janvier 2018

Données importantes de politique monétaire pour la semaine se terminant le 12 janvier 2018

Taux d'intérêt de référence de la BNS

En %

Date	Marge de fluctuation du Libor à trois mois	Libor à trois mois ¹	Taux spécial (facilité pour resserrements de liquidités) ²	Taux d'intérêt sur les avoirs en comptes de virement ³
08.01.18	-1.25 - -0.25	-0.73560	0.50	-0.75
09.01.18	-1.25 - -0.25	-0.73560	0.50	-0.75
10.01.18	-1.25 - -0.25	-0.73560	0.50	-0.75
11.01.18	-1.25 - -0.25	-0.73560	0.50	-0.75
12.01.18	-1.25 - -0.25	-0.73560	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 Rates⁴

En %

Date	SARON Fixing de 12h00	SARON Clôture du négoce	SAR1W Clôture du négoce	SAR1M Clôture du négoce	SAR3M Clôture du négoce
08.01.18	-0.738	-0.740	-0.766	-0.803	-0.819
09.01.18	-0.740	-0.741	-0.774	-0.816	-1.001
10.01.18	-0.739	-0.738	-0.814	-0.811	-0.874
11.01.18	-0.742	-0.738	-0.816	-0.822	-0.887
12.01.18	-0.740	-0.738	-0.815	-0.822	-0.865

4 Les Swiss Average Rates sont des taux d'intérêt pondérés par le volume, calculés par SIX Swiss Exchange sur la base des transactions conclues et des 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.

Communiqué de presse

Moyenne des avoirs à vue en francs à la BNS, pour la semaine se terminant le 12 janvier 2018

En millions de francs

Avoirs en comptes de virement des banques en Suisse	473'922
Autres avoirs à vue en francs	99'890
Total des avoirs à vue en francs à la BNS	573'812

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
24.11.17	478'954	22.12.17	478'838
01.12.17	476'807	29.12.17	475'039
08.12.17	476'668	05.01.18	473'525
15.12.17	477'537	12.01.18	473'641
Valeur en fin de période	478'246		

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 d'application	Exigence	Actifs pouvant être pris en compte ⁶	Billets et pièces suisses	Avoirs en comptes de virement à la BNS	Accomplissement en %	Taux d'intérêt ⁷ en %
20.11.16 - 19.12.16	15'766	464'061	6'628	457'433	2'943	3.27
20.12.16 - 19.01.17	15'806	472'308	7'222	465'086	2'988	3.26
20.01.17 - 19.02.17	15'684	471'982	6'686	465'296	3'009	3.26
20.02.17 - 19.03.17	15'630	475'609	6'154	469'455	3'043	3.26
20.03.17 - 19.04.17	15'665	483'315	6'460	476'854	3'085	3.29
20.04.17 - 19.05.17	15'842	488'200	6'562	481'638	3'082	3.26
20.05.17 - 19.06.17	16'020	488'306	6'616	481'690	3'048	3.26
20.06.17 - 19.07.17	16'065	491'370	6'544	484'826	3'059	3.26
20.07.17 - 19.08.17	16'082	481'971	6'513	475'457	2'997	3.26
20.08.17 - 19.09.17	16'068	477'128	6'327	470'801	2'970	3.26
20.09.17 - 19.10.17	15'931	474'559	6'228	468'330	2'979	3.26
20.10.17 - 19.11.17	15'880	474'167	6'228	467'939	2'986	3.26

⁶ Somme des billets et pièces suisses ainsi que des avoirs en comptes de virement à la BNS.

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