



## Communiqué de presse

### Communication

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

Zurich, le 16 octobre 2017

## Données importantes de politique monétaire pour la semaine se terminant le 13 octobre 2017

### Taux d'intérêt de référence de la BNS

En %

| Date     | Marge de fluctuation<br>du Libor à trois mois | Libor à trois mois <sup>1</sup> | Taux spécial (facilité<br>pour resserrements<br>de liquidités) <sup>2</sup> | Taux d'intérêt sur les<br>avoirs en comptes de<br>virement <sup>3</sup> |
|----------|---|---------------------------------|---|---|
| 09.10.17 | -1.25 - -0.25                                 | -0.72600                        | 0.50  | -0.75   |
| 10.10.17 | -1.25 - -0.25                                 | -0.72600                        | 0.50  | -0.75   |
| 11.10.17 | -1.25 - -0.25                                 | -0.72600                        | 0.50  | -0.75   |
| 12.10.17 | -1.25 - -0.25                                 | -0.72640                        | 0.50  | -0.75   |
| 13.10.17 | -1.25 - -0.25                                 | -0.72640                        | 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<sup>4</sup>

En %

| Date     | SARON<br>Fixing de 12h00 | SARON<br>Clôture du négoce | SAR1W<br>Clôture du négoce | SAR1M<br>Clôture du négoce | SAR3M<br>Clôture du négoce |
|----------|--------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 09.10.17 | -0.737                   | -0.738                     | -0.795                     | -0.845                     | -1.050                     |
| 10.10.17 | -0.740                   | -0.741                     | -0.767                     | -0.822                     | -0.910                     |
| 11.10.17 | -0.742                   | -0.738                     | -0.752                     | -0.839                     | -0.910                     |
| 12.10.17 | -0.738                   | -0.737                     | -0.783                     | -0.783                     | .                          |
| 13.10.17 | -0.741                   | -0.738                     | -0.791                     | -0.811                     | -0.905                     |

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 13 octobre 2017

En millions de francs

|   |                |
|---|----------------|
| Avoirs en comptes de virement des banques en Suisse | 471'303        |
| Autres avoirs à vue en francs                       | 107'203        |
| <b>Total des avoirs à vue en francs à la BNS</b>    | <b>578'506</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<br>Moyenne jusqu'au | Avoirs en comptes de virement | Période d'application en cours<br>Moyenne jusqu'au | Avoirs en comptes de virement |
|--|-------------------------------|--|-------------------------------|
| 25.08.17   | 471'729                       | 22.09.17   | 475'615                       |
| 01.09.17   | 469'999                       | 29.09.17   | 473'766                       |
| 08.09.17   | 470'511                       | 06.10.17   | 473'399                       |
| 15.09.17   | 471'040                       | 13.10.17   | 472'788                       |
| Valeur en fin de période                             | 471'760                       |  |                               |

<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 d'application | Exigence | Actifs pouvant être pris en compte <sup>6</sup> | Billets et pièces suisses | Avoirs en comptes de virement à la BNS | Accomplissement en % | Taux d'intérêt <sup>7</sup> en % |
|-----------------------|----------|---|---------------------------|--|----------------------|----------------------------------|
| 20.08.16 - 19.09.16   | 15'266   | 444'472   | 6'537                     | 437'936                                | 2'912                | 3.26                             |
| 20.09.16 - 19.10.16   | 15'419   | 456'829   | 6'383                     | 450'446                                | 2'963                | 3.26                             |
| 20.10.16 - 19.11.16   | 15'520   | 458'411   | 6'266                     | 452'145                                | 2'954                | 3.26                             |
| 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                             |

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

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