

Communication

Case postale, CH-8022 Zurich
Téléphone +41 44 631 31 11
Fax +41 44 631 39 10

Zurich, le 3 août 2009

Données importantes de politique monétaire pour la semaine se terminant le 31 juillet 2009

Taux d'intérêt de référence de la BNS

Date	Marge de fluctuation du Libor à trois mois	Libor à trois mois	Taux spécial de la facilité pour resserrements de liquidités*
27.07.09	0.00% - 0.75%	0.36000%	0.52%
28.07.09	0.00% - 0.75%	0.36000%	0.52%
29.07.09	0.00% - 0.75%	0.36000%	0.52%
30.07.09	0.00% - 0.75%	0.36000%	0.52%
31.07.09	0.00% - 0.75%	0.36000%	0.51%

* Repo-Overnight-Index (BNS) de la veille + 0.5 point.

Repo-Overnight-Index (BNS)

Date	Taux de référence (pondéré)*	Maximum de la journée	Minimum de la journée	Volume des opérations en millions de francs	Nombre d'opérations
27.07.09	0.02%	0.04%	0.01%	2'776	34
28.07.09	0.02%	0.05%	0.01%	3'233	46
29.07.09	0.02%	0.02%	0.01%	5'054	61
30.07.09	0.01%	0.02%	0.01%	2'331	31
31.07.09	0.02%	0.03%	0.01%	3'960	48

* Le Repo-Overnight-Index (BNS) est la moyenne des taux d'intérêt sur les opérations "overnight-GC" que les banques commerciales ont conclues entre elles au moyen de la plate-forme de négoce Eurex Repo. La moyenne est pondérée par le volume des opérations. Seules les opérations portant sur des titres admis par la BNS dans ses pensions sont prises en considération. La BNS reprend des données établies par Eurex Zürich AG.

Avoirs en comptes de virement des banques en Suisse, en moyenne hebdomadaire

(en millions de francs)

Moyenne de la semaine se terminant le 31 juillet 2009

62'312

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

(en millions de francs)

Période d'application précédente		Période d'application en cours	
Moyenne jusqu'au	Avoirs en comptes de virement	Moyenne jusqu'au	Avoirs en comptes de virement
26.06.09	63'356	24.07.09	62'038
03.07.09	66'955	31.07.09	62'198
10.07.09	67'037		
17.07.09	67'133		
Moyenne de la période	66'960		

* 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*	Billets et pièces	Avoirs en comptes de virement	Accomplissement en %	Taux d'intérêt**
20.06.08 - 19.07.08	9'407	10'822	5'685	5'137	115	5.81%
20.07.08 - 19.08.08	9'295	10'858	5'675	5'183	117	5.87%
20.08.08 - 19.09.08	9'097	10'656	5'567	5'089	117	5.83%
20.09.08 - 19.10.08	8'984	14'043	6'433	7'610	156	5.24%
20.10.08 - 19.11.08	9'039	14'435	6'600	7'835	160	4.43%
20.11.08 - 19.12.08	9'162	31'164	6'559	24'605	340	4.05%
20.12.08 - 19.01.09	9'239	45'750	7'431	38'319	495	4.02%
20.01.09 - 19.02.09	9'096	52'506	6'403	46'103	577	4.03%
20.02.09 - 19.03.09	8'990	52'526	6'503	46'023	584	4.02%
20.03.09 - 19.04.09	8'937	74'472	6'515	67'957	833	4.02%
20.04.09 - 19.05.09	8'910	72'983	6'342	66'641	819	4.03%
20.05.09 - 19.06.09	8'917	66'421	5'841	60'580	745	4.02%

* Somme des billets, pièces et avoirs en comptes de virement.

** Pour le calcul de la pénalité à verser en cas de détention insuffisante de réserves minimales.