

Communication

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

Zurich, le 23 novembre 2009

Données importantes de politique monétaire pour la semaine se terminant le 20 novembre 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* |
|----------|---|--------------------|---|
| 16.11.09 | 0.00% - 0.75% | 0.25500% | 0.53% |
| 17.11.09 | 0.00% - 0.75% | 0.25500% | 0.53% |
| 18.11.09 | 0.00% - 0.75% | 0.25333% | 0.53% |
| 19.11.09 | 0.00% - 0.75% | 0.25167% | 0.52% |
| 20.11.09 | 0.00% - 0.75% | 0.25167% | 0.52% |

* Jusqu'au 24.08.2009: Repo-Overnight-Index (BNS) de la veille + 50 points de base. A partir du 25.08.2009: SARON (Swiss Average Rate Overnight), fixing de 12h00 + 50 points de base.

Swiss Average Rates*

| Date | SARON Fixing de 12h00 | SARON Clôture du négoce | SAR1W Clôture du négoce | SAR1M Clôture du négoce | SAR3M Clôture du négoce |
|----------|--------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| 16.11.09 | 0.026% | 0.026% | 0.046% | 0.060% | 0.140% |
| 17.11.09 | 0.027% | 0.028% | 0.045% | 0.063% | 0.080% |
| 18.11.09 | 0.026% | 0.022% | 0.045% | 0.067% | 0.150% |
| 19.11.09 | 0.025% | 0.022% | 0.045% | 0.064% | 0.150% |
| 20.11.09 | 0.025% | 0.022% | 0.048% | 0.058% | 0.116% |

* 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 électronique de négoce d'Eurex. Les Swiss Average Rates sont calculés par SIX Swiss Exchange.

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

(en millions de francs)

Moyenne de la semaine se terminant le 20 novembre 2009

44'556

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 |
| 23.10.09 | 46'650 | 20.11.09 | 47'503 |
| 30.10.09 | 45'356 | | |
| 06.11.09 | 44'097 | | |
| 13.11.09 | 43'651 | | |
| Moyenne de la période | 43'731 | | |

* 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** |
|---------------------|----------------|-------------------------------------|-------------------|-------------------------------|----------------------|------------------|
| 20.09.08 - 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% |
| 20.06.09 - 19.07.09 | 8'783 | 72'650 | 5'739 | 66'911 | 827 | 4.02% |
| 20.07.09 - 19.08.09 | 8'855 | 68'344 | 5'886 | 62'458 | 772 | 4.02% |
| 20.08.09 - 19.09.09 | 8'889 | 60'246 | 5'571 | 54'674 | 678 | 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.