

## Communication

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

Zurich, le 18 octobre 2010

## Données importantes de politique monétaire pour la semaine se terminant le 15 octobre 2010

### Taux d'intérêt de référence de la BNS (en pour-cent)

| Date     | Marge de fluctuation<br>du Libor à trois mois | Libor à trois mois | Taux spécial de la facilité<br>pour resserrements de liquidités* |
|----------|---|--------------------|--|
| 11.10.10 | 0.00 - 0.75                                   | 0.17583            | 0.56   |
| 12.10.10 | 0.00 - 0.75                                   | 0.17417            | 0.55   |
| 13.10.10 | 0.00 - 0.75                                   | 0.17250            | 0.54   |
| 14.10.10 | 0.00 - 0.75                                   | 0.17250            | 0.55   |
| 15.10.10 | 0.00 - 0.75                                   | 0.17417            | 0.55   |

\* SARON (Swiss Average Rate Overnight), fixing de 12h00 + 50 points de base.

### Swiss Average Rates\* (en pour-cent)

| 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 |
|----------|--------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 11.10.10 | 0.057                    | 0.045                      | 0.152                      | 0.189                      | 0.256                      |
| 12.10.10 | 0.046                    | 0.036                      | 0.143                      | 0.208                      | 0.261                      |
| 13.10.10 | 0.042                    | 0.036                      | 0.150                      | 0.210                      | 0.282                      |
| 14.10.10 | 0.046                    | 0.038                      | 0.144                      | 0.170                      | 0.277                      |
| 15.10.10 | 0.049                    | 0.039                      | 0.102                      | 0.194                      | 0.253                      |

\* 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 15 octobre 2010

31 597

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

(en millions de francs)

| Période d'application précédente<br>Moyenne jusqu'au | Avoirs en comptes<br>de virement | Période d'application en cours<br>Moyenne jusqu'au | Avoirs en comptes<br>de virement |
|--|----------------------------------|--|----------------------------------|
| 20.08.10   | 45 972                           | 24.09.10   | 24 231                           |
| 27.08.10   | 37 047                           | 01.10.10   | 27 670                           |
| 03.09.10   | 33 111                           | 08.10.10   | 29 641                           |
| 10.09.10   | 30 855                           | 15.10.10   | 30 168                           |
| 17.09.10   | 30 200                           |  |                                  |
| Moyenne de la période                                | 30 069                           |  |                                  |

\* 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<br>requis | Actifs pou-<br>vant être pris<br>en compte* | Billets et<br>pièces | Avoirs en<br>comptes de<br>virement | Accompli-<br>sissement<br>en % | Taux<br>d'intérêt**<br>en % |
|---------------------|-------------------|---|----------------------|-------------------------------------|--------------------------------|-----------------------------|
| 20.08.09 - 19.09.09 | 8 889             | 60 246                                      | 5 571                | 54 674                              | 678                            | 4.02                        |
| 20.09.09 - 19.10.09 | 8 970             | 53 275                                      | 5 635                | 47 640                              | 594                            | 4.02                        |
| 20.10.09 - 19.11.09 | 8 884             | 49 361                                      | 5 655                | 43 706                              | 556                            | 4.03                        |
| 20.11.09 - 19.12.09 | 8 894             | 49 091                                      | 5 711                | 43 380                              | 552                            | 4.03                        |
| 20.12.09 - 19.01.10 | 8 963             | 46 945                                      | 6 421                | 40 525                              | 524                            | 4.03                        |
| 20.01.10 - 19.02.10 | 9 010             | 43 653                                      | 5 775                | 37 878                              | 484                            | 4.02                        |
| 20.02.10 - 19.03.10 | 9 067             | 49 483                                      | 5 849                | 43 634                              | 546                            | 4.03                        |
| 20.03.10 - 19.04.10 | 9 153             | 55 434                                      | 6 121                | 49 314                              | 606                            | 4.02                        |
| 20.04.10 - 19.05.10 | 9 254             | 66 883                                      | 5 833                | 61 050                              | 723                            | 4.02                        |
| 20.05.10 - 19.06.10 | 9 412             | 85 203                                      | 6 082                | 79 121                              | 905                            | 4.02                        |
| 20.06.10 - 19.07.10 | 9 759             | 64 450                                      | 5 785                | 58 665                              | 660                            | 4.05                        |
| 20.07.10 - 19.08.10 | 9 945             | 53 731                                      | 5 600                | 48 132                              | 540                            | 4.05                        |

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

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