



# Boletín del Mercado de Deuda Pública

## Resumen semanal de negociación de terceros



Número 1015

22 JUN 2009 - 26 JUN 2009

Importes en millones de euros y precios en tanto por ciento

### I. OPERACIONES DE COMPRAVENTA SIMPLE AL CONTADO

#### 1. DEUDA DEL ESTADO

| E M I S I O N                     | NUMERO OPERAC. | IMPORTE CONTRATADO | PRECIO MEDIO (EX-CUPON) | RENTDO. INTERNO MEDIO |
|-----------------------------------|----------------|--------------------|-------------------------|-----------------------|
| ES0000012064 O EST 5.15 30.07.09  | 73             | 1.168,49           | 100,37                  | 0,73                  |
| ES0000012239 O EST 4.00 31.01.10  | 106            | 574,28             | 101,89                  | 0,79                  |
| ES00000120E9 B EST 3.25 30.07.10  | 187            | 740,11             | 102,40                  | 1,03                  |
| ES00000120Z4 B EST 4.10 30.04.11  | 100            | 1.261,78           | 104,69                  | 1,13                  |
| ES0000012387 O EST 5.40 30.07.11  | 164            | 1.289,26           | 107,54                  | 1,69                  |
| ES0000012452 O EST 5.35 31.10.11  | 63             | 450,94             | 107,83                  | 1,90                  |
| ES0000011595 O EST 8.70 28.02.12  | 14             | 17,02              | 117,13                  | 2,05                  |
| ES00000121I8 B EST 2.75 30.04.12  | 44             | 725,50             | 101,26                  | 2,28                  |
| ES0000012791 O EST 5.00 30.07.12  | 128            | 1.243,15           | 108,15                  | 2,24                  |
| ES00000120L4 B EST 3.90 31.10.12  | 110            | 548,12             | 104,60                  | 2,45                  |
| ES0000011660 O EST 6.15 31.01.13  | 30             | 369,82             | 112,18                  | 2,56                  |
| ES0000012866 O EST 4.20 30.07.13  | 96             | 1.231,50           | 105,27                  | 2,82                  |
| ES00000121H0 B EST 4.25 31.01.14  | 150            | 1.393,13           | 105,25                  | 3,01                  |
| ES0000012098 O EST 4.75 30.07.14  | 57             | 270,64             | 107,08                  | 3,22                  |
| ES0000012916 O EST 4.40 31.01.15  | 83             | 611,13             | 103,15                  | 3,75                  |
| ES00000120G4 O EST 3.15 31.01.16  | 115            | 899,42             | 97,10                   | 3,65                  |
| ES00000120J8 O EST 3.80 31.01.17  | 84             | 485,15             | 99,17                   | 3,92                  |
| ES0000012783 O EST 5.50 30.07.17  | 80             | 1.763,63           | 111,07                  | 3,88                  |
| ES00000121A5 O EST 4.10 30.07.18  | 130            | 1.553,66           | 99,35                   | 4,19                  |
| ES00000121L2 O EST 4.60 30.07.19  | 155            | 2.065,20           | 102,68                  | 4,27                  |
| ES0000012106 O EST 4.30 31.10.19  | 69             | 616,37             | 100,24                  | 4,27                  |
| ES00000121G2 O EST 4.80 31.01.24  | 33             | 478,47             | 101,03                  | 4,70                  |
| ES0000011868 O EST 6.00 31.01.29  | 105            | 909,45             | 107,19                  | 5,38                  |
| ES0000012411 O EST 5.75 30.07.32  | 95             | 1.518,81           | 102,77                  | 5,53                  |
| ES0000012932 O EST 4.20 31.01.37  | 114            | 1.378,19           | 95,51                   | 4,48                  |
| ES00000120N0 O EST 4.90 30.07.40  | 56             | 785,96             | 98,57                   | 4,99                  |
| ES0000012122 N EST CUP-0 30.07.09 | 16             | 8,20               | 99,90                   | 1,08                  |
| ES0000012221 C EST CUP-0 30.07.09 | 10             | 24,33              | 99,88                   | 1,42                  |
| ES0000011827 C EST CUP-0 31.01.10 | 2              | 0,00               | 99,54                   | 0,77                  |
| ES0000012296 N EST CUP-0 31.01.10 | 2              | 0,50               | 99,46                   | 0,89                  |
| ES00000120F6 N EST CUP-0 30.07.10 | 2              | 1,60               | 98,82                   | 1,08                  |
| ES0000011835 C EST CUP-0 31.01.11 | 4              | 32,61              | 98,45                   | 0,99                  |
| ES0000011843 C EST CUP-0 31.01.12 | 3              | 0,12               | 94,47                   | 2,21                  |
| ES00000120X9 N EST CUP-0 31.10.12 | 1              | 4,70               | 91,87                   | 2,56                  |
| ES0000012304 N EST CUP-0 30.07.14 | 2              | 18,20              | 85,33                   | 3,17                  |
| ES0000012353 C EST CUP-0 30.07.14 | 1              | 0,05               | 84,52                   | 3,35                  |
| ES0000012601 C EST CUP-0 30.07.15 | 9              | 52,60              | 80,58                   | 3,61                  |

(CONTINUA)

**I. OPERACIONES DE COMPRAVENTA SIMPLE AL CONTADO**

## 1. DEUDA DEL ESTADO

| EMISION                           | NUMERO OPERAC. | IMPORTE CONTRATADO | PRECIO MEDIO (EX-CUPON) | RENDTO. INTERNO MEDIO |
|-----------------------------------|----------------|--------------------|-------------------------|-----------------------|
| ES0000012619 C EST CUP-0 30.07.16 | 2              | 0,24               | 76,87                   | 3,77                  |
| ES0000012627 C EST CUP-0 30.07.17 | 1              | 0,25               | 72,90                   | 3,98                  |
| ES0000011983 C EST CUP-0 31.01.24 | 2              | 0,54               | 50,22                   | 4,83                  |
| ES0000012593 N EST CUP-0 30.07.32 | 3              | 43,00              | 31,26                   | 5,16                  |
| ES0L00907177 L EST CUP-0 17.07.09 | 10             | 10,24              | 99,97                   | 0,53                  |
| ES0L00908217 L EST CUP-0 21.08.09 | 24             | 39,02              | 99,84                   | 0,98                  |
| ES0L00909181 L EST CUP-0 18.09.09 | 16             | 4,33               | 99,88                   | 0,52                  |
| ES0L00910239 L EST CUP-0 23.10.09 | 20             | 22,33              | 99,74                   | 0,79                  |
| ES0L00911203 L EST CUP-0 20.11.09 | 14             | 51,81              | 99,53                   | 1,14                  |
| ES0L00912185 L EST CUP-0 18.12.09 | 8              | 61,51              | 99,63                   | 0,75                  |
| ES0L01001228 L EST CUP-0 22.01.10 | 5              | 116,04             | 99,61                   | 0,67                  |
| ES0L01002192 L EST CUP-0 19.02.10 | 12             | 17,31              | 99,46                   | 0,82                  |
| ES0L01003190 L EST CUP-0 19.03.10 | 6              | 169,09             | 99,45                   | 0,76                  |
| ES0L01004230 L EST CUP-0 23.04.10 | 12             | 11,42              | 99,27                   | 0,87                  |
| ES0L01005211 L EST CUP-0 21.05.10 | 3              | 0,14               | 98,90                   | 1,21                  |
| ES0L01006185 L EST CUP-0 18.06.10 | 19             | 230,01             | 99,10                   | 0,92                  |
| <b>T O T A L E S</b>              | <b>2.645</b>   | <b>25.269,36</b>   |                         |                       |

LA AUSENCIA DE PRECIO Y RENDIMIENTO EN ALGUNA EMISION INDICA QUE ESAS OPERACIONES ESTAN REALIZADAS A TIPOS FUERA DE MERCADO.

## 2. DEUDA DE COMUNIDADES AUTONOMAS Y OTROS EMISORES

| EMISION                           | NUMERO OPERAC. | IMPORTE CONTRATADO | PRECIO MEDIO (EX-CUPON) | RENDTO. INTERNO MEDIO |
|-----------------------------------|----------------|--------------------|-------------------------|-----------------------|
| ES0001353186 O NAV 4.85 28.11.11  | 2              | 3,00               | 105,17                  | 2,61                  |
| ES0000090565 B AND 4.50 19.06.12  | 2              | 11,63              | 104,15                  | 3,02                  |
| ES0001353137 O NAV 5.45 14.05.13  | 1              | 2,00               | 106,11                  | 3,73                  |
| ES0000101362 B MAD 4.05 12.06.13  | 1              | 0,36               | 100,24                  | 3,98                  |
| ES0000090433 O AND 4.30 10.10.13  | 3              | 0,07               | 101,91                  | 3,80                  |
| ES0000101339 B MAD 4.31 06.03.14  | 3              | 0,15               | 100,10                  | 4,28                  |
| ES0001351222 B CLE 4.30 07.05.14  | 9              | 2,44               | 100,54                  | 4,17                  |
| ES0000101388 O MAD 4.62 23.06.15  | 4              | 42,30              | 100,03                  | 4,62                  |
| ES0000090581 O AND 4.75 24.01.18  | 2              | 0,12               | 98,26                   | 5,00                  |
| ES05000903R9 P AND CUP-0 25.09.09 | 5              | 8,50               | 99,70                   | 1,20                  |
| ES05000903U3 P AND CUP-0 18.12.09 | 8              | 22,40              | 99,32                   | 1,44                  |
| ES05000904A3 P AND CUP-0 25.06.10 | 1              | 3,00               | 98,44                   | 1,59                  |
| ES05000904G0 P AND CUP-0 30.12.10 | 1              | 1,50               | 97,30                   | 1,83                  |
| <b>T O T A L E S</b>              | <b>42</b>      | <b>97,46</b>       |                         |                       |

**I. OPERACIONES DE COMPRAVENTA SIMPLE AL CONTADO**

## 3. DEUDA DEL ESTADO (RESUMEN POR PLAZOS)

| P L A Z O S     | T O T A L      |                    |               | COMPRAS POR TERCEROS |                    |               | VENTAS POR TERCEROS |                    |               |
|-----------------|----------------|--------------------|---------------|----------------------|--------------------|---------------|---------------------|--------------------|---------------|
|                 | NUMERO OPERAC. | IMPORTE CONTRATADO | RENDTO. MEDIO | NUMERO OPERAC.       | IMPORTE CONTRATADO | RENDTO. MEDIO | NUMERO OPERAC.      | IMPORTE CONTRATADO | RENDTO. MEDIO |
| HASTA 6 MESES   | 191            | 1.390,25           | 0,81          | 65                   | 441,21             | 0,80          | 126                 | 949,05             | 0,81          |
| 6 A 12 MESES    | 167            | 1.118,79           | 0,80          | 60                   | 544,03             | 0,82          | 107                 | 574,76             | 0,78          |
| 1 A 2 AÑOS      | 293            | 2.036,09           | 1,10          | 96                   | 834,70             | 1,10          | 198                 | 1.201,40           | 1,11          |
| DE 2 A 4 AÑOS   | 555            | 4.648,64           | 2,10          | 226                  | 1.852,68           | 2,08          | 329                 | 2.795,96           | 2,12          |
| DE 4 A 8 AÑOS   | 599            | 4.962,06           | 3,28          | 223                  | 2.224,88           | 3,31          | 376                 | 2.737,18           | 3,25          |
| DE 8 A 12 AÑOS  | 434            | 5.999,11           | 4,13          | 175                  | 2.456,73           | 4,14          | 259                 | 3.542,38           | 4,13          |
| DE 12 A 20 AÑOS | 140            | 1.388,46           | 5,16          | 60                   | 603,79             | 5,18          | 80                  | 784,66             | 5,13          |
| MAS DE 20 AÑOS  | 267            | 3.725,96           | 5,04          | 119                  | 1.399,69           | 5,00          | 149                 | 2.326,28           | 5,07          |
| T O T A L E S   | 2.645          | 25.269,36          |               | 1.022                | 10.357,70          |               | 1.623               | 14.911,66          |               |

## 4. DEUDA DE COMUNIDADES AUTONOMAS Y OTROS EMISORES (RESUMEN POR PLAZOS)

| P L A Z O S     | T O T A L      |                    |               | COMPRAS POR TERCEROS |                    |               | VENTAS POR TERCEROS |                    |               |
|-----------------|----------------|--------------------|---------------|----------------------|--------------------|---------------|---------------------|--------------------|---------------|
|                 | NUMERO OPERAC. | IMPORTE CONTRATADO | RENDTO. MEDIO | NUMERO OPERAC.       | IMPORTE CONTRATADO | RENDTO. MEDIO | NUMERO OPERAC.      | IMPORTE CONTRATADO | RENDTO. MEDIO |
| HASTA 6 MESES   | 13             | 30,90              | 1,38          | 13                   | 30,90              | 1,38          | -                   | -                  | -             |
| 6 A 12 MESES    | 1              | 3,00               | 1,59          | 1                    | 3,00               | 1,59          | -                   | -                  | -             |
| 1 A 2 AÑOS      | 1              | 1,50               | 1,83          | 1                    | 1,50               | 1,83          | -                   | -                  | -             |
| DE 2 A 4 AÑOS   | 6              | 16,98              | 3,05          | 4                    | 13,48              | 3,00          | 2                   | 3,50               | 3,26          |
| DE 4 A 8 AÑOS   | 19             | 44,96              | 4,59          | 14                   | 43,49              | 4,60          | 5                   | 1,48               | 4,31          |
| DE 8 A 12 AÑOS  | 2              | 0,12               | 5,00          | 2                    | 0,12               | 5,00          | -                   | -                  | -             |
| DE 12 A 20 AÑOS | -              | -                  | -             | -                    | -                  | -             | -                   | -                  | -             |
| MAS DE 20 AÑOS  | -              | -                  | -             | -                    | -                  | -             | -                   | -                  | -             |
| T O T A L E S   | 42             | 97,46              |               | 35                   | 92,48              |               | 7                   | 4,98               |               |

**II. OPERACIONES DE COMPRAVENTA DOBLE**

## 1. CON COMPROMISO DE RECOMPRA (DEUDA DEL ESTADO. RESUMEN POR PLAZOS)

| P L A Z O S    | BONOS Y OBLIGACIONES |                    |            | DEUDA DEL ESTADO SEGREGADA |                    |            | LETRAS DEL TESORO |                    |            |
|----------------|----------------------|--------------------|------------|----------------------------|--------------------|------------|-------------------|--------------------|------------|
|                | NUMERO OPERAC.       | IMPORTE CONTRATADO | TIPO MEDIO | NUMERO OPERAC.             | IMPORTE CONTRATADO | TIPO MEDIO | NUMERO OPERAC.    | IMPORTE CONTRATADO | TIPO MEDIO |
| DIA A DIA      | 26.937               | 118.465,14         | 0,55       | 1.698                      | 8.771,09           | 0,59       | 8.374             | 49.158,82          | 0,53       |
| HASTA 1 SEMANA | 3.618                | 5.970,47           | 0,58       | 30                         | 84,20              | 0,56       | 554               | 1.872,27           | 0,60       |
| HASTA 1 MES    | 1.487                | 1.611,64           | 0,53       | 41                         | 73,37              | 0,43       | 891               | 868,69             | 0,57       |
| MAS DE 1 MES   | 321                  | 300,25             | 0,81       | 2                          | 0,88               | 0,51       | 425               | 254,46             | 0,69       |
| T O T A L E S  | 32.362               | 126.347,49         |            | 1.771                      | 8.929,54           |            | 10.244            | 52.154,24          |            |

## II. OPERACIONES DE COMPRAVENTA DOBLE

### 2. SIMULTANEAS AL CONTADO (DEUDA DEL ESTADO. RESUMEN POR PLAZOS)

| P L A Z O S    | BONOS Y OBLIGACIONES |                    |            | DEUDA DEL ESTADO SEGREGADA |                    |            | LETRAS DEL TESORO |                    |            |
|----------------|----------------------|--------------------|------------|----------------------------|--------------------|------------|-------------------|--------------------|------------|
|                | NUMERO OPERAC.       | IMPORTE CONTRATADO | TIPO MEDIO | NUMERO OPERAC.             | IMPORTE CONTRATADO | TIPO MEDIO | NUMERO OPERAC.    | IMPORTE CONTRATADO | TIPO MEDIO |
| DIA A DIA      | 316                  | 9.101,56           | 0,62       | -                          | -                  | -          | -                 | -                  | -          |
| HASTA 1 SEMANA | 19                   | 613,42             | 0,45       | -                          | -                  | -          | -                 | -                  | -          |
| HASTA 1 MES    | 30                   | 1.474,21           | 0,60       | -                          | -                  | -          | -                 | -                  | -          |
| MAS DE 1 MES   | 4                    | 281,46             | 0,59       | -                          | -                  | -          | -                 | -                  | -          |
| T O T A L E S  | 369                  | 11.470,65          |            | -                          | -                  |            | -                 | -                  |            |