



# Boletín de la Central de Anotaciones



BANCO DE ESPAÑA

Año 14

Número 3410

1 de marzo de 2002

Importes en millones de euros y precios en tanto por ciento

Depósito legal: M-4894-98

## I. OPERACIONES DE COMPRAVENTA SIMPLE AL CONTADO

### 1. DEUDA DEL ESTADO

| E M I S I O N                       | NUMERO OPERACS | IMPORTE CONTRATADO | PRECIO (EX-CUPON) |         |         | RENTDO. INTERNO MEDIO | ANTERIOR PRECIO MEDIO (FECHA) |
|-------------------------------------|----------------|--------------------|-------------------|---------|---------|-----------------------|-------------------------------|
|                                     |                |                    | MEDIO             | MAXIMO  | MINIMO  |                       |                               |
| ES0000011371-5 O EST 10.30 15.06.02 | 7              | 131,00             | 101,826           | 101,840 | 101,820 | 3,38                  | 101,840 (28/02/2002)          |
| ES0000012072-5 B EST 4.25 30.07.02  | 4              | 121,80             | 100,320           | 100,340 | 100,320 | 3,39                  | 100,333 (28/02/2002)          |
| ES0000011645-5 B EST 5.25 31.01.03  | 3              | 40,00              | 101,505           | 101,520 | 101,500 | 3,53                  | 101,524 (27/02/2002)          |
| ES0000012247-5 B EST 3.00 31.01.03  | 2              | 15,00              | 99,570            | 99,570  | 99,570  | 3,48                  | 99,568 (28/02/2002)           |
| ES0000012361-5 B EST 4.60 30.07.03  | 14             | 129,00             | 101,181           | 101,220 | 101,130 | 3,71                  | 101,192 (28/02/2002)          |
| ES0000011421-5 O EST 10.50 30.10.03 | 1              | 2,50               | 110,550           | 110,550 | 110,550 | 3,78                  | 110,630 (26/02/2002)          |
| ES0000012080-5 B EST 4.50 30.07.04  | 15             | 125,24             | 100,905           | 100,920 | 100,890 | 4,09                  | 100,923 (28/02/2002)          |
| ES0000012437-5 B EST 4.65 31.10.04  | 32             | 246,00             | 101,170           | 101,200 | 101,100 | 4,16                  | 101,185 (28/02/2002)          |
| ES0000012254-5 B EST 3.25 31.01.05  | 25             | 212,30             | 97,343            | 97,400  | 97,280  | 4,24                  | 97,388 (28/02/2002)           |
| ES0000012379-5 B EST 4.95 30.07.05  | 12             | 71,90              | 101,808           | 101,860 | 101,760 | 4,35                  | 101,852 (28/02/2002)          |
| ES0000012445-5 B EST 4.80 31.10.06  | 21             | 201,02             | 100,890           | 101,040 | 100,770 | 4,58                  | 100,994 (28/02/2002)          |
| ES0000011629-5 O EST 7.35 31.03.07  | 1              | 0,27               | 111,610           | 111,610 | 111,610 | 4,72                  | 111,730 (28/02/2002)          |
| ES0000011652-5 O EST 6.00 31.01.08  | 46             | 431,03             | 105,943           | 106,010 | 105,630 | 4,82                  | 105,866 (28/02/2002)          |
| ES0000012064-5 O EST 5.15 30.07.09  | 23             | 190,70             | 100,975           | 101,060 | 100,720 | 4,98                  | 101,027 (28/02/2002)          |
| ES0000012239-5 O EST 4.00 31.01.10  | 16             | 179,06             | 93,296            | 93,350  | 93,200  | 5,05                  | 93,303 (28/02/2002)           |
| ES0000012387-5 O EST 5.40 30.07.11  | 33             | 211,85             | 101,960           | 102,070 | 101,680 | 5,13                  | 102,009 (28/02/2002)          |
| ES0000012452-5 O EST 5.35 31.10.11  | 116            | 874,20             | 101,640           | 101,770 | 101,300 | 5,13                  | 101,620 (28/02/2002)          |
| ES0000011660-5 O EST 6.15 31.01.13  | 8              | 75,00              | 107,736           | 107,910 | 107,670 | 5,20                  | 107,550 (28/02/2002)          |
| ES0000012098-5 O EST 4.75 30.07.14  | 13             | 58,72              | 95,221            | 95,460  | 94,850  | 5,28                  | 95,318 (28/02/2002)           |
| ES0000011868-5 O EST 6.00 31.01.29  | 17             | 77,50              | 107,481           | 107,670 | 107,440 | 5,46                  | 106,800 (28/02/2002)          |
| ES0000012411-5 O EST 5.75 30.07.32  | 15             | 62,50              | 101,993           | 102,260 | 101,400 | 5,46                  | 101,735 (28/02/2002)          |
| ES0000012270-3 P EST CUP-0 31.01.03 | 1              | 3,00               | 96,953            | 96,953  | 96,953  | 3,46                  | 96,738 (06/02/2002)           |
| ES0000011785-4 C EST CUP-0 31.01.06 | 2              | 2,00               | 84,295            | 84,295  | 84,295  | 4,47                  | 84,355 (28/02/2002)           |
| ES0L00206216-3 L EST CUP-0 21.06.02 | 2              | 3,10               | 99,031            | 99,032  | 99,031  | 3,23                  | 98,911 (15/02/2002)           |
| ES0L00302288-3 L EST CUP-0 28.02.03 | 2              | 1,01               | 96,618            | 96,619  | 96,563  | 3,49                  | 96,591 (28/02/2002)           |
| ES0L00308145-3 L EST CUP-0 14.08.03 | 1              | 0,11               | 94,742            | 94,742  | 94,742  | 3,73                  | 94,732 (27/02/2002)           |
| <b>T O T A L E S</b>                | <b>432</b>     | <b>3.465,80</b>    |                   |         |         |                       |                               |

### 2. DEUDA DE COMUNIDADES AUTONOMAS Y OTROS EMISORES

NO HAY OPERACIONES

### 3. VALORES DE OTROS ESTADOS DE LA UNION MONETARIA

NO HAY OPERACIONES

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

## 4. DEUDA DEL ESTADO. RESUMEN POR PLAZOS DE VIDA RESIDUAL

| P L A Z O S     | BONOS Y OBLIGACIONES DEL ESTADO |            | DEUDA DEL ESTADO SEGREGADA |            | P L A Z O S   | LETRAS DEL TESORO |            |
|-----------------|---------------------------------|------------|----------------------------|------------|---------------|-------------------|------------|
|                 | IMPORTE NOMINAL                 | TIPO MEDIO | IMPORTE NOMINAL            | TIPO MEDIO |               | IMPORTE NOMINAL   | TIPO MEDIO |
| 6 A 12 MESES    | 55,00                           | 3,52       | 3,00                       | 3,46       | HASTA UN MES  | -                 | -          |
| 1 A 2 AÑOS      | 131,50                          | 3,71       | -                          | -          | 1 A 3 MESES   | -                 | -          |
| 2 A 3 AÑOS      | 583,54                          | 4,17       | -                          | -          | 3 A 6 MESES   | 3,10              | 3,23       |
| 3 A 4 AÑOS      | 71,90                           | 4,35       | 2,00                       | 4,47       | SEIS MESES    | -                 | -          |
| DE 4 A 6 AÑOS   | 632,31                          | 4,74       | -                          | -          | 6 A 12 MESES  | -                 | -          |
| DE 6 A 10 AÑOS  | 1.455,81                        | 5,10       | -                          | -          | UN AÑO        | 1,01              | 3,49       |
| DE 10 A 20 AÑOS | 133,72                          | 5,24       | -                          | -          | 12 A 18 MESES | 0,11              | 3,73       |
| MAS DE 20 AÑOS  | 140,00                          | 5,46       | -                          | -          |               |                   |            |

## 5. DEUDA DE CC.AA. Y OTROS EMISORES. RESUMEN POR PLAZOS DE VIDA RESIDUAL

N O H A Y O P E R A C I O N E S

**II. OPERACIONES DE COMPRAVENTA SIMPLE A PLAZO**

## 1. DEUDA DEL ESTADO.- POR EMISIONES

| FECHAS DE VALOR | EMISION               | NUM. OPS. | IMPORTE CONTRATADO | TIPO MEDIO | FECHAS DE VALOR | EMISION | NUM. OPS. | IMPORTE CONTRATADO | TIPO MEDIO |
|-----------------|-----------------------|-----------|--------------------|------------|-----------------|---------|-----------|--------------------|------------|
| 11/03/2002      | ES0000012098-5 O 4.75 | 1         | 5,00               | 5,26       |                 |         |           |                    |            |
| T O T A L       |                       |           |                    |            |                 |         | 1         | 5,00               |            |

## 2. DEUDA DE COMUNIDADES AUTONOMAS Y OTROS EMISORES.- POR EMISIONES

N O H A Y O P E R A C I O N E S

## 3. VALORES DE OTROS ESTADOS DE LA UNION MONETARIA.- POR EMISIONES

N O H A Y O P E R A C I O N E S

## 4. POSICION ABIERTA POR OPERACIONES A PLAZO (CON BONOS Y OBLIGACIONES DEL ESTADO)

| EMISIONES              | FECHAS DE EJECUCION |            |            |            |            |            |            | TOTAL  |
|------------------------|---------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|--------|
|                        | 04/03/2002          | 05/03/2002 | 06/03/2002 | 07/03/2002 | 02/04/2002 | 09/07/2002 | OTRAS FEC. |        |
| ES0000011371-5 O 10.30 | -                   | 65,00      | 51,00      | -          | -          | -          | -          | 116,00 |
| ES0000011421-5 O 10.50 | -                   | 2,50       | -          | -          | -          | -          | -          | 2,50   |
| ES0000011470-5 O 8.20  | -                   | 3,74       | -          | -          | -          | -          | 50,00      | 53,74  |
| ES0000011488-5 O 8.00  | 10,00               | -          | -          | -          | -          | -          | 6,01       | 16,01  |
| ES0000011579-5 O 8.80  | -                   | 0,00       | -          | -          | -          | -          | 69,00      | 69,00  |
| ES0000011595-5 O 8.70  | -                   | -          | -          | -          | -          | -          | 51,69      | 51,69  |
| ES0000011629-5 O 7.35  | 4,05                | 2,00       | -          | -          | -          | -          | -          | 6,05   |
| ES0000011645-5 B 5.25  | 15,00               | -          | 30,00      | -          | -          | -          | -          | 45,00  |
| ES0000011652-5 O 6.00  | 52,02               | 30,00      | 237,03     | -          | 250,00     | -          | 20,00      | 589,04 |

(CONTINUA)

## II. OPERACIONES DE COMPRAVENTA SIMPLE A PLAZO

### 4. POSICION ABIERTA POR OPERACIONES A PLAZO (CON BONOS Y OBLIGACIONES DEL ESTADO)

| EMISIONES             | FECHAS DE EJECUCION |                 |                 |               |               |               |                 | TOTAL           |
|-----------------------|---------------------|-----------------|-----------------|---------------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|
|                       | 04/03/2002          | 05/03/2002      | 06/03/2002      | 07/03/2002    | 02/04/2002    | 09/07/2002    | OTRAS FEC.      |                 |
| ES0000011660-5 o 6.15 | 10,03               | 20,00           | 40,00           | -             | -             | -             | -               | 70,03           |
| ES0000011868-5 o 6.00 | 0,34                | -               | 55,00           | -             | -             | -             | -               | 55,34           |
| ES0000012064-5 o 5.15 | 5,00                | 47,00           | 104,30          | -             | -             | -             | -               | 156,30          |
| ES0000012080-5 B 4.50 | 35,90               | 54,00           | 45,24           | -             | -             | -             | 25,00           | 160,14          |
| ES0000012098-5 o 4.75 | 17,10               | 63,36           | 37,66           | -             | -             | 289,00        | 49,50           | 456,62          |
| ES0000012239-5 o 4.00 | 19,03               | 127,06          | 20,00           | -             | -             | -             | 140,00          | 306,09          |
| ES0000012247-5 B 3.00 | 51,51               | 15,00           | 10,00           | -             | -             | -             | 2,00            | 78,51           |
| ES0000012254-5 B 3.25 | 25,22               | 55,43           | 49,27           | -             | -             | -             | -               | 129,92          |
| ES0000012361-5 B 4.60 | 87,00               | 63,00           | 33,00           | -             | -             | -             | -               | 183,00          |
| ES0000012379-5 B 4.95 | 91,70               | 37,04           | 33,50           | -             | -             | -             | 293,00          | 455,24          |
| ES0000012387-5 o 5.40 | 72,40               | 147,20          | 58,00           | 340,00        | -             | -             | 50,00           | 667,60          |
| ES0000012411-5 o 5.75 | 10,00               | 12,00           | 20,00           | -             | -             | -             | -               | 42,00           |
| ES0000012437-5 B 4.65 | 145,10              | 85,00           | 43,00           | -             | -             | -             | -               | 273,09          |
| ES0000012445-5 B 4.80 | 50,00               | 48,12           | 61,80           | 50,00         | -             | -             | 300,00          | 509,91          |
| ES0000012452-5 o 5.35 | 157,10              | 131,00          | 279,00          | 230,00        | 20,00         | 300,00        | -               | 1.117,10        |
| <b>TOTALES</b>        | <b>858,48</b>       | <b>1.008,44</b> | <b>1.207,80</b> | <b>620,00</b> | <b>270,00</b> | <b>589,00</b> | <b>1.056,20</b> | <b>5.609,92</b> |

## III. OPERACIONES DE COMPRAVENTA DOBLE

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

| PLAZOS         | BONOS Y OBLIGACIONES DEL ESTADO |            |             |             | DEUDA DEL ESTADO SEGREGADA |            |             |             | LETRAS DEL TESORO |            |             |             |
|----------------|---------------------------------|------------|-------------|-------------|----------------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
|                | IMPORTE EFECTIVO                | TIPO MEDIO | TIPO MAXIMO | TIPO MINIMO | IMPORTE EFECTIVO           | TIPO MEDIO | TIPO MAXIMO | TIPO MINIMO | IMPORTE EFECTIVO  | TIPO MEDIO | TIPO MAXIMO | TIPO MINIMO |
| DIA A DIA      | 370,49                          | 3,27       | 3,28        | 3,25        | -                          | -          | -           | -           | 3,62              | 3,27       | 3,27        | 3,26        |
| 2 A 5 DIAS     | -                               | -          | -           | -           | -                          | -          | -           | -           | -                 | -          | -           | -           |
| UNA SEMANA     | -                               | -          | -           | -           | -                          | -          | -           | -           | 23,00             | 3,26       | 3,26        | 3,26        |
| QUINCE DIAS    | -                               | -          | -           | -           | -                          | -          | -           | -           | 30,00             | 3,26       | 3,26        | 3,26        |
| UN MES         | -                               | -          | -           | -           | -                          | -          | -           | -           | -                 | -          | -           | -           |
| DOS MESES      | -                               | -          | -           | -           | -                          | -          | -           | -           | -                 | -          | -           | -           |
| TRES MESES     | -                               | -          | -           | -           | -                          | -          | -           | -           | -                 | -          | -           | -           |
| 3 A 6 MESES    | -                               | -          | -           | -           | -                          | -          | -           | -           | -                 | -          | -           | -           |
| 6 A 12 MESES   | -                               | -          | -           | -           | -                          | -          | -           | -           | -                 | -          | -           | -           |
| <b>TOTALES</b> | <b>370,49</b>                   |            |             |             | <b>0,00</b>                |            |             |             | <b>56,62</b>      |            |             |             |

### 2. OPERACIONES CON COMPROMISO DE RECOMPRA. DEUDA DE CC.AA. Y OTROS EMISORES. RESUMEN POR PLAZOS

N O H A Y O P E R A C I O N E S

### 3. OPERACIONES CON COMPROMISO DE RECOMPRA. DEUDAS DE OTROS ESTADOS. RESUMEN POR PLAZOS

N O H A Y O P E R A C I O N E S

## III. OPERACIONES DE COMPRAVENTA DOBLE

## 4. SIMULTANEAS AL CONTADO (CON DEUDA DEL ESTADO)

| EMISIONES              | TOTAL        |                       | PLAZOS DE RETROCESION |               |                              |               |                         |               |                     |               |                     |               |
|------------------------|--------------|-----------------------|-----------------------|---------------|------------------------------|---------------|-------------------------|---------------|---------------------|---------------|---------------------|---------------|
|                        |              |                       | DIA A DIA             |               | HASTA 1 SEMANA<br>(2-8 DIAS) |               | QUINCENA<br>(9-17 DIAS) |               | MES<br>(18-33 DIAS) |               | MAS DE 1 MES        |               |
|                        | NUM.<br>OPS. | IMPORTE<br>CONTRATADO | IMPORTE<br>CONTRAT.   | TIPO<br>MEDIO | IMPORTE<br>CONTRAT.          | TIPO<br>MEDIO | IMPORTE<br>CONTRAT.     | TIPO<br>MEDIO | IMPORTE<br>CONTRAT. | TIPO<br>MEDIO | IMPORTE<br>CONTRAT. | TIPO<br>MEDIO |
| ES0000011371-5 o 10.30 | 6            | 74,67                 | 33,44                 | 3,27          | 28,23                        | 3,27          | -                       | -             | -                   | -             | 13,00               | 3,25          |
| ES0000011413-5 o 10.90 | 15           | 212,48                | 164,40                | 3,29          | 9,10                         | 3,23          | 0,37                    | 3,23          | 38,42               | 3,25          | 0,19                | 3,20          |
| ES0000011421-5 o 10.50 | 5            | 66,08                 | 16,97                 | 3,28          | -                            | -             | 43,85                   | 3,26          | -                   | -             | 5,26                | 3,30          |
| ES0000011470-5 o 8.20  | 5            | 378,83                | 377,83                | 3,27          | 1,00                         | 3,23          | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0000011488-5 o 8.00  | 8            | 93,69                 | 89,19                 | 3,28          | 2,00                         | 3,22          | -                       | -             | -                   | -             | 2,50                | 3,24          |
| ES0000011512-5 o 10.00 | 10           | 566,61                | 554,55                | 3,27          | -                            | -             | 0,06                    | 3,25          | -                   | -             | 12,00               | 3,27          |
| ES0000011546-5 o 10.15 | 19           | 711,82                | 654,73                | 3,28          | 50,02                        | 3,24          | 0,08                    | 3,20          | 7,00                | 3,27          | -                   | -             |
| ES0000011579-5 o 8.80  | 1            | 13,00                 | 13,00                 | 3,27          | -                            | -             | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0000011595-5 o 8.70  | 6            | 147,99                | 147,89                | 3,28          | 0,10                         | 3,22          | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0000011629-5 o 7.35  | 5            | 28,11                 | 12,33                 | 3,28          | 11,75                        | 3,23          | 1,03                    | 3,22          | 3,01                | 3,26          | -                   | -             |
| ES0000011645-5 B 5.25  | 24           | 1.194,71              | 1.037,61              | 3,28          | 157,10                       | 3,26          | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0000011652-5 o 6.00  | 21           | 1.279,22              | 1.249,19              | 3,28          | 3,68                         | 3,25          | 11,26                   | 3,25          | -                   | -             | 15,09               | 3,25          |
| ES0000011660-5 o 6.15  | 5            | 56,67                 | 53,67                 | 3,24          | 3,00                         | 3,22          | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0000011868-5 o 6.00  | 17           | 321,04                | 117,96                | 3,25          | 174,31                       | 3,24          | 28,77                   | 3,27          | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0000012064-5 o 5.15  | 23           | 526,84                | 469,17                | 3,28          | 38,84                        | 3,24          | 12,19                   | 3,27          | 6,65                | 3,26          | -                   | -             |
| ES0000012072-5 B 4.25  | 18           | 1.283,79              | 1.176,43              | 3,28          | 107,35                       | 3,26          | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0000012080-5 B 4.50  | 12           | 252,15                | 139,67                | 3,27          | 112,48                       | 3,25          | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0000012098-5 o 4.75  | 17           | 379,40                | 251,68                | 3,25          | 52,00                        | 3,20          | 9,72                    | 3,27          | -                   | -             | 66,00               | 3,23          |
| ES0000012239-5 o 4.00  | 20           | 1.067,47              | 1.066,47              | 3,28          | 1,00                         | 3,16          | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0000012247-5 B 3.00  | 19           | 1.416,20              | 1.279,19              | 3,27          | 132,00                       | 3,27          | -                       | -             | 5,01                | 3,24          | -                   | -             |
| ES0000012254-5 B 3.25  | 16           | 382,32                | 358,42                | 3,28          | 11,40                        | 3,22          | 12,50                   | 3,23          | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0000012361-5 B 4.60  | 18           | 441,16                | 332,56                | 3,27          | 108,60                       | 3,27          | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0000012379-5 B 4.95  | 14           | 411,98                | 317,98                | 3,26          | 26,00                        | 3,26          | 10,00                   | 3,26          | 45,00               | 3,25          | 13,00               | 3,24          |
| ES0000012387-5 o 5.40  | 17           | 843,44                | 749,21                | 3,28          | 88,52                        | 3,29          | -                       | -             | -                   | -             | 5,70                | 3,26          |
| ES0000012411-5 o 5.75  | 13           | 500,98                | 456,98                | 3,29          | 33,00                        | 3,26          | 11,00                   | 3,23          | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0000012437-5 B 4.65  | 11           | 422,69                | 419,69                | 3,27          | 3,00                         | 3,22          | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0000012445-5 B 4.80  | 22           | 1.005,90              | 742,00                | 3,29          | 213,90                       | 3,26          | 50,00                   | 3,24          | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0000012452-5 o 5.35  | 36           | 2.485,86              | 2.457,23              | 3,27          | 21,09                        | 3,22          | 6,00                    | 3,22          | 1,55                | 3,25          | -                   | -             |
| ES0000012049-4 C CUP-0 | 1            | 1,70                  | -                     | -             | -                            | -             | 1,70                    | 2,25          | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0L00203155-3 L CUP-0 | 1            | 25,04                 | 25,04                 | 3,28          | -                            | -             | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0L00203288-3 L CUP-0 | 2            | 5,64                  | 2,00                  | 3,27          | 3,64                         | 3,27          | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0L00204260-3 L CUP-0 | 2            | 82,59                 | 70,59                 | 3,28          | 12,00                        | 3,27          | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0L00205242-3 L CUP-0 | 1            | 60,54                 | 60,54                 | 3,28          | -                            | -             | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0L00206075-3 L CUP-0 | 3            | 109,90                | 103,90                | 3,28          | -                            | -             | -                       | -             | 6,00                | 3,24          | -                   | -             |
| ES0L00206216-3 L CUP-0 | 2            | 200,00                | 200,00                | 3,28          | -                            | -             | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0L00207057-3 L CUP-0 | 1            | 100,00                | 100,00                | 3,28          | -                            | -             | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0L00207198-3 L CUP-0 | 2            | 49,49                 | 47,46                 | 3,27          | -                            | -             | 2,03                    | 3,25          | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0L00208162-3 L CUP-0 | 1            | 1,09                  | 1,09                  | 3,25          | -                            | -             | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0L00209137-3 L CUP-0 | 1            | 62,08                 | 62,08                 | 3,27          | -                            | -             | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ES0L00212057-3 L CUP-0 | 2            | 110,94                | 110,94                | 3,27          | -                            | -             | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |

(CONTINUA)

### III. OPERACIONES DE COMPRAVENTA DOBLE

#### 4. SIMULTANEAS AL CONTADO (CON DEUDA DEL ESTADO)

| EMISIONES              | TOTAL        |                       | PLAZOS DE RETROCESION |               |                              |               |                         |               |                     |               |                     |               |
|------------------------|--------------|-----------------------|-----------------------|---------------|------------------------------|---------------|-------------------------|---------------|---------------------|---------------|---------------------|---------------|
|                        |              |                       | DIA A DIA             |               | HASTA 1 SEMANA<br>(2-8 DIAS) |               | QUINCENA<br>(9-17 DIAS) |               | MES<br>(18-33 DIAS) |               | MAS DE 1 MES        |               |
|                        | NUM.<br>OPS. | IMPORTE<br>CONTRATADO | IMPORTE<br>CONTRAT.   | TIPO<br>MEDIO | IMPORTE<br>CONTRAT.          | TIPO<br>MEDIO | IMPORTE<br>CONTRAT.     | TIPO<br>MEDIO | IMPORTE<br>CONTRAT. | TIPO<br>MEDIO | IMPORTE<br>CONTRAT. | TIPO<br>MEDIO |
| ESOL00301033-3 L CUP-0 | 4            | 183,71                | 183,71                | 3,29          | -                            | -             | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ESOL00302288-3 L CUP-0 | 3            | 65,37                 | 65,37                 | 3,29          | -                            | -             | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ESOL00305232-3 L CUP-0 | 1            | 200,00                | 200,00                | 3,28          | -                            | -             | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| ESOL00308145-3 L CUP-0 | 1            | 50,00                 | 50,00                 | 3,29          | -                            | -             | -                       | -             | -                   | -             | -                   | -             |
| <b>TOTALES</b>         | <b>431</b>   | <b>17.873,16</b>      | <b>16.022,14</b>      |               | <b>1.405,10</b>              |               | <b>200,54</b>           |               | <b>112,63</b>       |               | <b>132,75</b>       |               |

#### 5. SIMULTANEAS AL CONTADO (CON DEUDA DE COMUNIDADES AUTONOMAS Y OTROS EMISORES)

N O H A Y O P E R A C I O N E S

#### 6. SIMULTANEAS AL CONTADO (CON VALORES DE OTROS ESTADOS U.M.)

N O H A Y O P E R A C I O N E S

#### 7. SIMULTANEAS AL CONTADO. DEUDA DEL ESTADO. RESUMEN POR PLAZOS

| PLAZOS         | BONOS Y OBLIGACIONES DEL ESTADO |               |                |                | DEUDA DEL ESTADO SEGREGADA |               |                |                | LETRAS DEL TESORO  |               |                |                |
|----------------|---------------------------------|---------------|----------------|----------------|----------------------------|---------------|----------------|----------------|--------------------|---------------|----------------|----------------|
|                | IMPORTE<br>NOMINAL              | TIPO<br>MEDIO | TIPO<br>MAXIMO | TIPO<br>MINIMO | IMPORTE<br>NOMINAL         | TIPO<br>MEDIO | TIPO<br>MAXIMO | TIPO<br>MINIMO | IMPORTE<br>NOMINAL | TIPO<br>MEDIO | TIPO<br>MAXIMO | TIPO<br>MINIMO |
| DIA A DIA      | 14.739,43                       | 3,28          | 3,31           | 3,17           | -                          | -             | -              | -              | 1.282,71           | 3,28          | 3,29           | 3,25           |
| 2 A 5 DIAS     | 436,95                          | 3,27          | 3,30           | 3,20           | -                          | -             | -              | -              | -                  | -             | -              | -              |
| UNA SEMANA     | 952,51                          | 3,25          | 3,28           | 3,02           | -                          | -             | -              | -              | 15,64              | 3,27          | 3,27           | 3,27           |
| QUINCE DIAS    | 196,81                          | 3,25          | 3,27           | 3,20           | 1,70                       | 2,25          | 2,25           | 2,25           | 2,03               | 3,25          | 3,25           | 3,25           |
| UN MES         | 106,63                          | 3,25          | 3,27           | 3,22           | -                          | -             | -              | -              | 6,00               | 3,24          | 3,24           | 3,24           |
| DOS MESES      | 93,59                           | 3,24          | 3,25           | 3,23           | -                          | -             | -              | -              | -                  | -             | -              | -              |
| TRES MESES     | 19,90                           | 3,26          | 3,27           | 3,20           | -                          | -             | -              | -              | -                  | -             | -              | -              |
| 3 A 6 MESES    | 18,26                           | 3,27          | 3,30           | 3,25           | -                          | -             | -              | -              | -                  | -             | -              | -              |
| 6 A 12 MESES   | 1,00                            | 3,27          | 3,27           | 3,27           | -                          | -             | -              | -              | -                  | -             | -              | -              |
| <b>TOTALES</b> | <b>16.565,09</b>                |               |                |                | <b>1,70</b>                |               |                |                | <b>1.306,37</b>    |               |                |                |

#### 8. SIMULTANEAS AL CONTADO. DEUDA DE CC.AA. Y OTROS EMISORES. RESUMEN POR PLAZOS

N O H A Y O P E R A C I O N E S

#### 9. SIMULTANEAS AL CONTADO. DEUDA OTROS ESTADOS. RESUMEN POR PLAZOS

N O H A Y O P E R A C I O N E S

#### 10. SIMULTANEAS A PLAZO (CON DEUDA DEL ESTADO)

N O H A Y O P E R A C I O N E S

### III. OPERACIONES DE COMPRAVENTA DOBLE

#### 11. SIMULTANEAS A PLAZO (CON DEUDA COMUNIDADES AUTONOMAS Y OTROS EMISORES)

N O H A Y O P E R A C I O N E S

#### 12. SIMULTANEAS A PLAZO (CON VALORES DE OTROS ESTADOS DE LA U.M.)

N O H A Y O P E R A C I O N E S

#### 13. POSICION ABIERTA POR OPERACIONES SIMULTANEAS (CON BONOS Y OBLIGACIONES DEL ESTADO)

| EMISIONES              | FECHAS DE EJECUCION |            |            |            |            |            |            | TOTAL     |
|------------------------|---------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|-----------|
|                        | 04/03/2002          | 05/03/2002 | 06/03/2002 | 07/03/2002 | 08/03/2002 | 11/03/2002 | OTRAS FEC. |           |
| ES0000011371-5 o 10.30 | 49,85               | 10,18      | 83,95      | -          | -          | 62,39      | 196,13     | 402,49    |
| ES0000011413-5 o 10.90 | 336,15              | 1,00       | 89,03      | 29,50      | 56,87      | 3,50       | 795,33     | 1.311,38  |
| ES0000011421-5 o 10.50 | 87,10               | 13,17      | 62,10      | 13,00      | 90,00      | -          | 466,49     | 731,85    |
| ES0000011470-5 o 8.20  | 314,51              | -          | -          | 0,37       | 8,00       | 7,00       | 12,41      | 342,29    |
| ES0000011488-5 o 8.00  | 139,31              | 32,10      | 2,00       | 12,76      | 3,18       | 49,97      | 229,62     | 468,93    |
| ES0000011512-5 o 10.00 | 1.087,08            | 90,00      | -          | 132,80     | 51,88      | -          | 224,01     | 1.585,76  |
| ES0000011546-5 o 10.15 | 381,66              | 313,21     | 52,01      | 1,50       | 21,92      | 39,00      | 685,22     | 1.494,53  |
| ES0000011579-5 o 8.80  | 14,62               | 16,60      | 52,05      | 18,00      | 58,00      | -          | 124,41     | 283,67    |
| ES0000011595-5 o 8.70  | 147,89              | 68,10      | -          | 2,10       | 13,60      | -          | 5,80       | 237,48    |
| ES0000011629-5 o 7.35  | 17,33               | 48,98      | 8,32       | 4,76       | -          | -          | 221,16     | 300,54    |
| ES0000011645-5 B 5.25  | 718,81              | 422,93     | 45,40      | -          | -          | 147,44     | 468,56     | 1.803,14  |
| ES0000011652-5 o 6.00  | 1.129,59            | 634,56     | 111,29     | 3,76       | 80,08      | 41,77      | 1.881,51   | 3.882,55  |
| ES0000011660-5 o 6.15  | 84,89               | 50,24      | 13,76      | 38,80      | 26,00      | 126,31     | 446,61     | 786,60    |
| ES0000011868-5 o 6.00  | 168,55              | 96,60      | 204,18     | 206,24     | 74,00      | 64,00      | 297,88     | 1.111,44  |
| ES0000012064-5 o 5.15  | 500,05              | 486,00     | 522,65     | 8,60       | 30,23      | 37,85      | 1.011,82   | 2.597,20  |
| ES0000012072-5 B 4.25  | 762,55              | 223,43     | 269,50     | 18,50      | 67,35      | 47,31      | 1.051,67   | 2.440,30  |
| ES0000012080-5 B 4.50  | 145,72              | 147,67     | 74,28      | 19,00      | 17,27      | 25,42      | 176,28     | 605,64    |
| ES0000012098-5 o 4.75  | 206,54              | 172,76     | 80,50      | 45,00      | 187,37     | 205,21     | 761,33     | 1.658,71  |
| ES0000012239-5 o 4.00  | 802,82              | 663,28     | 4,50       | 135,73     | 47,36      | 22,04      | 233,88     | 1.909,60  |
| ES0000012247-5 B 3.00  | 1.068,71            | 480,49     | 31,18      | 11,92      | 50,00      | 6,43       | 558,34     | 2.207,06  |
| ES0000012254-5 B 3.25  | 342,65              | 162,50     | 45,54      | 15,44      | 21,49      | 11,74      | 561,13     | 1.160,49  |
| ES0000012361-5 B 4.60  | 499,18              | 163,07     | 70,84      | 15,53      | 110,87     | 240,33     | 723,65     | 1.823,48  |
| ES0000012379-5 B 4.95  | 337,72              | 219,32     | 391,28     | 116,03     | 0,15       | 62,64      | 1.494,38   | 2.621,54  |
| ES0000012387-5 o 5.40  | 783,44              | 394,25     | 60,52      | 123,65     | -          | 36,91      | 1.171,67   | 2.570,44  |
| ES0000012411-5 o 5.75  | 322,40              | 111,00     | 72,00      | -          | 56,00      | 29,00      | 297,52     | 887,92    |
| ES0000012437-5 B 4.65  | 303,91              | 64,00      | 28,00      | 96,22      | 13,00      | -          | 686,68     | 1.191,81  |
| ES0000012445-5 B 4.80  | 453,00              | 215,00     | 190,20     | 144,00     | 84,70      | 52,00      | 1.147,82   | 2.286,72  |
| ES0000012452-5 o 5.35  | 1.758,10            | 780,48     | 53,97      | 354,48     | 114,17     | 51,80      | 1.749,84   | 4.862,84  |
| TOTALES                | 12.964,09           | 6.080,90   | 2.619,06   | 1.567,69   | 1.283,48   | 1.370,04   | 17.681,14  | 43.566,40 |

## IV. MERCADO DE DINERO

## 1. DEPOSITOS INTERBANCARIOS NO TRANSFERIBLES

| PLAZOS           | IMPORTE<br>NEGOCIADO | TIPOS DE INTERES |        |        | OPER. VIVAS<br>POR PLAZOS<br>RESIDUALES |
|------------------|----------------------|------------------|--------|--------|---|
|                  |                      | MEDIO            | MAXIMO | MINIMO |   |
| DIA A DIA        | 8.804,95             | 3,30             | 3,35   | 3,27   | 9.977,89                                |
| 2 A 5 DIAS       | 106,50               | 3,32             | 3,32   | 3,30   | 1.219,44                                |
| UNA SEMANA       | 140,00               | 3,31             | 3,32   | 3,31   | 1.123,32                                |
| QUINCE DIAS      | 36,00                | 3,31             | 3,31   | 3,30   | 1.120,92                                |
| 18-26 DIAS       | -                    | -                | -      | -      | 1.072,67                                |
| UN MES           | 29,50                | 3,33             | 3,34   | 3,32   | 454,47                                  |
| 1 A 2 MESES      | -                    | -                | -      | -      | 835,32                                  |
| DOS MESES        | -                    | -                | -      | -      | 336,15                                  |
| 2 A 3 MESES      | 6,00                 | 3,34             | 3,34   | 3,34   | 819,29                                  |
| TRES MESES       | 13,90                | 3,35             | 3,35   | 3,35   | 661,54                                  |
| 3 A 6 MESES      | -                    | -                | -      | -      | 1.512,98                                |
| SEIS MESES       | 1,00                 | 3,41             | 3,41   | 3,41   | 524,22                                  |
| 6 A 12 MESES     | -                    | -                | -      | -      | 1.795,40                                |
| UN AÑO           | -                    | -                | -      | -      | 181,27                                  |
| MAS DE 1 AÑO     | -                    | -                | -      | -      | 359,51                                  |
| <b>T O T A L</b> | <b>9.137,85</b>      |                  |        |        | <b>21.994,40</b>                        |

## 2. F.R.A. (TIPOS MEDIOS DIARIOS)

| PLAZOS   | TIPOS MEDIOS |         |                 |
|----------|--------------|---------|-----------------|
|          | OFERTA       | DEMANDA | LIQUIDACION (*) |
| 1 MES    | 3,400        | 3,250   | 3,342           |
| 2 MESES  | 3,413        | 3,263   | 3,355           |
| 3 MESES  | 3,430        | 3,280   | 3,367           |
| 4 MESES  | 3,440        | 3,292   | 3,381           |
| 5 MESES  | 3,454        | 3,303   | 3,398           |
| 6 MESES  | 3,470        | 3,320   | 3,413           |
| 7 MESES  | 3,497        | 3,347   | 3,438           |
| 8 MESES  | 3,527        | 3,380   | 3,471           |
| 9 MESES  | 3,562        | 3,412   | 3,502           |
| 10 MESES | 3,596        | 3,450   | 3,539           |
| 11 MESES | 3,637        | 3,489   | 3,578           |
| 12 MESES | 3,680        | 3,530   | 3,617           |

(\*) TIPOS APLICABLES A LAS OPERACIONES A LIQUIDAR  
EL SEGUNDO DIA HABIL POSTERIOR A LA FECHA DE HOY

## 3. F.R.A. (DETALLE DE NEGOCIACION)

N O H A Y O P E R A C I O N E S

## IV. MERCADO DE DINERO

## 4. OPERACIONES F.R.A. PENDIENTES DE LIQUIDACION

| PLAZOS   | FECHAS DE INICIO |            |            |            |            |            |            |            | TOTAL  |
|----------|------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|--------|
|          | 20/03/2002       | 28/05/2002 | 06/03/2002 | 07/03/2002 | 08/03/2002 | 11/03/2002 | OTRAS FEC. | OTRAS FEC. |        |
| 9 MESES  | 10,00            | -          | -          | -          | -          | -          | -          | -          | 10,00  |
| 12 MESES | -                | 400,00     | -          | -          | -          | -          | -          | -          | 400,00 |
| TOTALES  | 10,00            | 400,00     | 0,00       | 0,00       | 0,00       | 0,00       | 0,00       | 0,00       | 410,00 |

## V. CARACTERISTICAS DE LOS VALORES EN CIRCULACION

## 1. DEUDA DEL ESTADO

| E M I S I O N                              | FECHA PROXIMO CUPON | NUM. CUP. AÑO | CUPON CORRIDO EUR/MILLON | SALDO EN CIRCULACION | SALDO DE TERCEROS | ULTIMO PRECIO MEDIO (FECHA) |
|--|---------------------|---------------|--------------------------|----------------------|-------------------|-----------------------------|
| ES0000011371-5 OBL ESTADO 10.30 15.06.02   | 15/06/2002          | 1             | 73.087,67                | 2.850,27             | 2.120,77          | 101,826 (01/03/2002)        |
| ES0000011413-5 OBL ESTADO 10.90 30.08.03   | 30/08/2002          | 1             | 54.649,32                | 5.025,33             | 4.239,07          | 110,210 (20/02/2002)        |
| ES0000011421-5 OBL ESTADO 10.50 30.10.03   | 30/10/2002          | 1             | 35.095,89                | 3.760,81             | 3.379,48          | 110,550 (01/03/2002)        |
| ES0000011470-5 OBL ESTADO 8.20 28.02.09    | 28/02/2003          | 1             | 224,66                   | 5.578,56             | 4.267,84          | 118,737 (28/02/2002)        |
| ES0000011488-5 OBL ESTADO 8.00 30.05.04    | 30/05/2002          | 1             | 60.273,97                | 5.065,51             | 4.122,44          | 108,120 (27/02/2002)        |
| ES0000011512-5 OBL ESTADO 10.00 28.02.05   | 28/02/2003          | 1             | 273,97                   | 4.896,50             | 3.694,53          | 115,613 (26/02/2002)        |
| ES0000011546-5 OBL ESTADO 10.15 31.01.06   | 31/01/2003          | 1             | 8.064,38                 | 3.403,61             | 2.718,50          | 119,805 (22/02/2002)        |
| ES0000011579-5 OBL ESTADO 8.80 30.04.06    | 30/04/2002          | 1             | 73.534,25                | 3.257,30             | 2.697,72          | 115,680 (28/02/2002)        |
| ES0000011595-5 OBL ESTADO 8.70 28.02.12    | 28/02/2003          | 1             | 238,36                   | 1.811,80             | 1.457,40          | 128,272 (07/02/2002)        |
| ES0000011629-5 OBL ESTADO 7.35 31.03.07    | 31/03/2002          | 1             | 67.458,90                | 4.238,41             | 3.156,08          | 111,610 (01/03/2002)        |
| ES0000011645-5 BON ESTADO 5.25 31.01.03    | 31/01/2003          | 1             | 4.171,23                 | 6.388,75             | 5.630,52          | 101,505 (01/03/2002)        |
| ES0000011652-5 OBL ESTADO 6.00 31.01.08    | 31/01/2003          | 1             | 4.767,12                 | 17.626,74            | 15.594,55         | 105,943 (01/03/2002)        |
| ES0000011660-5 OBL ESTADO 6.15 31.01.13    | 31/01/2003          | 1             | 4.886,30                 | 11.076,16            | 10.018,11         | 107,736 (01/03/2002)        |
| ES0000011868-5 OBL ESTADO 6.00 31.01.29    | 31/01/2003          | 1             | 4.767,12                 | 9.104,17             | 8.161,73          | 107,481 (01/03/2002)        |
| ES0000012064-5 OBL ESTADO 5.15 30.07.09    | 30/07/2002          | 1             | 30.194,52                | 12.280,49            | 11.388,06         | 100,975 (01/03/2002)        |
| ES0000012072-5 BON ESTADO 4.25 30.07.02    | 30/07/2002          | 1             | 24.917,81                | 9.087,18             | 8.490,21          | 100,320 (01/03/2002)        |
| ES0000012080-5 BON ESTADO 4.50 30.07.04    | 30/07/2002          | 1             | 26.383,56                | 9.165,76             | 8.471,76          | 100,905 (01/03/2002)        |
| ES0000012098-5 OBL ESTADO 4.75 30.07.14    | 30/07/2002          | 1             | 27.849,32                | 9.917,36             | 9.361,00          | 95,221 (01/03/2002)         |
| ES0000012239-5 OBL ESTADO 4.00 31.01.10    | 31/01/2003          | 1             | 3.178,08                 | 12.377,10            | 10.703,20         | 93,296 (01/03/2002)         |
| ES0000012247-5 BON ESTADO 3.00 31.01.03    | 31/01/2003          | 1             | 2.383,56                 | 6.728,56             | 6.066,55          | 99,570 (01/03/2002)         |
| ES0000012254-5 BON ESTADO 3.25 31.01.05    | 31/01/2003          | 1             | 2.582,19                 | 8.435,35             | 7.286,97          | 97,343 (01/03/2002)         |
| ES0000012262-5 NOT ESTADO 4.78 10.08.03/09 | 10/08/2002          | 1             | 26.584,66                | 500,00               | 424,93            | NO HAY                      |
| ES0000012361-5 BON ESTADO 4.60 30.07.03    | 30/07/2002          | 1             | 26.969,86                | 10.882,48            | 8.722,45          | 101,181 (01/03/2002)        |
| ES0000012379-5 BON ESTADO 4.95 30.07.05    | 30/07/2002          | 1             | 29.021,92                | 11.798,94            | 9.394,67          | 101,808 (01/03/2002)        |
| ES0000012387-5 OBL ESTADO 5.40 30.07.11    | 30/07/2002          | 1             | 31.660,27                | 12.807,90            | 11.386,91         | 101,960 (01/03/2002)        |
| ES0000012411-5 OBL ESTADO 5.75 30.07.32    | 30/07/2003          | 1             | 0,00                     | 4.800,88             | 4.526,50          | 101,993 (01/03/2002)        |
| ES0000012437-5 BON ESTADO 4.65 31.10.04    | 31/10/2002          | 1             | 15.415,07                | 9.266,45             | 7.826,34          | 101,170 (01/03/2002)        |
| ES0000012445-5 BON ESTADO 4.80 31.10.06    | 31/10/2002          | 1             | 15.912,33                | 8.275,45             | 5.973,49          | 100,890 (01/03/2002)        |
| ES0000012452-5 OBL ESTADO 5.35 31.10.11    | 31/10/2002          | 1             | 17.735,62                | 11.056,60            | 9.245,60          | 101,640 (01/03/2002)        |
| ES0000011686-3 PRL ESTADO CUP-0 31.01.03   | -                   | 0             | -                        | 2.683,64             | 2.602,45          | 96,747 (18/02/2002)         |
| ES0000011694-3 PRL ESTADO CUP-0 31.01.08   | -                   | 0             | -                        | 1.175,83             | 1.056,22          | 75,177 (08/02/2002)         |
| ES0000011702-3 PRL ESTADO CUP-0 31.01.13   | -                   | 0             | -                        | 887,86               | 755,66            | 57,165 (06/02/2002)         |
| ES0000011751-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.03   | -                   | 0             | -                        | 481,60               | 370,81            | 96,819 (19/02/2002)         |
| ES0000011769-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.04   | -                   | 0             | -                        | 335,60               | 273,98            | 92,938 (28/02/2002)         |

(CONTINUA)



## V. CARACTERISTICAS DE LOS VALORES EN CIRCULACION

## 1. DEUDA DEL ESTADO

| E M I S I O N                            | FECHA PROXIMO CUPON | NUM. CUP. AÑO | CUPON CORRIDO EUR/MILLON | SALDO EN CIRCULACION | SALDO DE TERCEROS | ULTIMO PRECIO MEDIO (FECHA) |
|--|---------------------|---------------|--------------------------|----------------------|-------------------|-----------------------------|
| ES0000011777-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.05 | -                   | 0             | -                        | 335,60               | 237,18            | 88,000 (31/01/2002)         |
| ES0000011785-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.06 | -                   | 0             | -                        | 315,20               | 210,16            | 84,295 (01/03/2002)         |
| ES0000011793-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.07 | -                   | 0             | -                        | 315,20               | 279,73            | 79,763 (12/02/2002)         |
| ES0000011801-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.08 | -                   | 0             | -                        | 315,20               | 249,58            | 75,195 (28/02/2002)         |
| ES0000011819-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.09 | -                   | 0             | -                        | 244,65               | 205,38            | 71,000 (31/01/2002)         |
| ES0000011827-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.10 | -                   | 0             | -                        | 244,65               | 193,19            | 67,000 (31/01/2002)         |
| ES0000011835-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.11 | -                   | 0             | -                        | 239,95               | 189,62            | 64,145 (07/02/2002)         |
| ES0000011843-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.12 | -                   | 0             | -                        | 239,95               | 187,73            | 60,000 (30/01/2002)         |
| ES0000011850-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.13 | -                   | 0             | -                        | 239,95               | 183,74            | 57,000 (30/01/2002)         |
| ES0000011876-3 PRL ESTADO CUP-0 31.01.29 | -                   | 0             | -                        | 3.089,10             | 3.060,37          | 23,677 (30/01/2002)         |
| ES0000011884-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.14 | -                   | 0             | -                        | 185,35               | 148,71            | 53,000 (30/01/2002)         |
| ES0000011892-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.15 | -                   | 0             | -                        | 185,35               | 156,85            | 50,000 (30/01/2002)         |
| ES0000011900-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.16 | -                   | 0             | -                        | 185,35               | 157,43            | 48,000 (30/01/2002)         |
| ES0000011918-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.17 | -                   | 0             | -                        | 185,35               | 143,22            | 45,000 (30/01/2002)         |
| ES0000011926-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.18 | -                   | 0             | -                        | 185,35               | 150,28            | 42,000 (30/01/2002)         |
| ES0000011934-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.19 | -                   | 0             | -                        | 185,35               | 169,86            | 40,000 (30/01/2002)         |
| ES0000011942-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.20 | -                   | 0             | -                        | 185,35               | 164,88            | 38,000 (30/01/2002)         |
| ES0000011959-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.21 | -                   | 0             | -                        | 185,35               | 158,01            | 36,000 (30/01/2002)         |
| ES0000011967-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.22 | -                   | 0             | -                        | 185,35               | 162,98            | 34,000 (30/01/2002)         |
| ES0000011975-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.23 | -                   | 0             | -                        | 185,35               | 151,96            | 32,000 (30/01/2002)         |
| ES0000011983-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.24 | -                   | 0             | -                        | 185,35               | 151,81            | 30,000 (30/01/2002)         |
| ES0000011991-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.25 | -                   | 0             | -                        | 185,35               | 161,23            | 29,000 (30/01/2002)         |
| ES0000012007-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.26 | -                   | 0             | -                        | 185,35               | 159,87            | 27,000 (30/01/2002)         |
| ES0000012023-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.27 | -                   | 0             | -                        | 185,35               | 162,46            | 26,000 (30/01/2002)         |
| ES0000012031-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.28 | -                   | 0             | -                        | 185,35               | 166,66            | 25,000 (30/01/2002)         |
| ES0000012049-4 CUP ESTADO CUP-0 31.01.29 | -                   | 0             | -                        | 185,35               | 147,92            | 24,000 (30/01/2002)         |
| ES0000012106-3 PRL ESTADO CUP-0 30.07.02 | -                   | 0             | -                        | 1.160,20             | 1.089,90          | 98,512 (08/02/2002)         |
| ES0000012114-3 PRL ESTADO CUP-0 30.07.04 | -                   | 0             | -                        | 984,20               | 930,70            | 90,800 (25/02/2002)         |
| ES0000012122-3 PRL ESTADO CUP-0 30.07.09 | -                   | 0             | -                        | 291,80               | 250,50            | 69,418 (25/02/2002)         |
| ES0000012155-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.02 | -                   | 0             | -                        | 149,52               | 108,19            | 98,646 (28/02/2002)         |
| ES0000012163-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.03 | -                   | 0             | -                        | 122,92               | 41,37             | 94,983 (27/02/2002)         |
| ES0000012171-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.04 | -                   | 0             | -                        | 115,92               | 55,13             | 90,750 (27/02/2002)         |
| ES0000012189-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.05 | -                   | 0             | -                        | 71,63                | 15,78             | 86,459 (25/02/2002)         |
| ES0000012197-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.06 | -                   | 0             | -                        | 63,27                | 20,64             | 82,000 (01/02/2002)         |
| ES0000012205-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.07 | -                   | 0             | -                        | 63,27                | 21,56             | 77,684 (08/02/2002)         |
| ES0000012213-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.08 | -                   | 0             | -                        | 63,27                | 25,03             | 73,000 (01/02/2002)         |
| ES0000012221-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.09 | -                   | 0             | -                        | 63,27                | 20,50             | 69,000 (01/02/2002)         |
| ES0000012270-3 PRL ESTADO CUP-0 31.01.03 | -                   | 0             | -                        | 170,10               | 167,20            | 96,953 (01/03/2002)         |
| ES0000012288-3 PRL ESTADO CUP-0 31.01.05 | -                   | 0             | -                        | 627,80               | 599,30            | 88,569 (26/02/2002)         |
| ES0000012296-3 PRL ESTADO CUP-0 31.01.10 | -                   | 0             | -                        | 117,50               | 113,50            | 67,157 (31/01/2002)         |
| ES0000012304-3 PRL ESTADO CUP-0 30.07.14 | -                   | 0             | -                        | 97,20                | 82,90             | 52,319 (24/01/2002)         |
| ES0000012312-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.10 | -                   | 0             | -                        | 48,24                | 8,16              | 65,000 (01/02/2002)         |
| ES0000012320-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.11 | -                   | 0             | -                        | 48,24                | 7,46              | 62,000 (01/02/2002)         |

(CONTINUA)

## V. CARACTERISTICAS DE LOS VALORES EN CIRCULACION

## 1. DEUDA DEL ESTADO

| EMISION                                  | FECHA PROXIMO CUPON | NUM. CUP. AÑO | CUPON CORRIDO EUR/MILLON | SALDO EN CIRCULACION | SALDO DE TERCEROS | ULTIMO PRECIO MEDIO (FECHA) |
|--|---------------------|---------------|--------------------------|----------------------|-------------------|-----------------------------|
| ES0000012338-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.12 | -                   | 0             | -                        | 27,33                | 8,35              | 59,000 (22/01/2002)         |
| ES0000012346-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.13 | -                   | 0             | -                        | 27,33                | 7,79              | 55,000 (22/01/2002)         |
| ES0000012353-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.14 | -                   | 0             | -                        | 27,33                | 23,33             | 52,000 (22/01/2002)         |
| ES0000012395-3 PRL ESTADO CUP-0 30.07.03 | -                   | 0             | -                        | 152,20               | 133,60            | 94,813 (13/02/2002)         |
| ES0000012403-3 PRL ESTADO CUP-0 30.07.05 | -                   | 0             | -                        | 169,00               | 165,50            | 86,381 (20/02/2002)         |
| ES0000012429-3 PRL ESTADO CUP-0 30.07.11 | -                   | 0             | -                        | 387,20               | 41,50             | 61,851 (27/02/2002)         |
| ES0000012460-3 PRL ESTADO CUP-0 31.10.04 | -                   | 0             | -                        | 157,60               | 153,60            | 88,200 (29/10/2001)         |
| ES0000012478-4 CUP ESTADO CUP-0 31.10.02 | -                   | 0             | -                        | 7,42                 | 0,00              | NO HAY                      |
| ES0000012486-4 CUP ESTADO CUP-0 31.10.03 | -                   | 0             | -                        | 7,42                 | 0,00              | NO HAY                      |
| ES0000012494-4 CUP ESTADO CUP-0 31.10.04 | -                   | 0             | -                        | 7,42                 | 0,00              | NO HAY                      |
| ES0000012502-3 PRL ESTADO CUP-0 31.10.06 | -                   | 0             | -                        | 2,00                 | 2,00              | 81,315 (17/12/2001)         |
| ES0000012528-4 CUP ESTADO CUP-0 31.10.05 | -                   | 0             | -                        | 0,10                 | 0,00              | NO HAY                      |
| ES0000012536-4 CUP ESTADO CUP-0 31.10.06 | -                   | 0             | -                        | 0,10                 | 0,00              | NO HAY                      |
| ES0000012593-3 PRL ESTADO CUP-0 30.07.32 | -                   | 0             | -                        | 395,00               | 310,00            | NO HAY                      |
| ES0000012601-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.15 | -                   | 0             | -                        | 22,71                | 17,83             | 49,000 (18/12/2001)         |
| ES0000012619-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.16 | -                   | 0             | -                        | 22,71                | 17,83             | 46,000 (18/12/2001)         |
| ES0000012627-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.17 | -                   | 0             | -                        | 22,71                | 17,83             | 44,000 (18/12/2001)         |
| ES0000012635-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.18 | -                   | 0             | -                        | 22,71                | 17,83             | 41,000 (18/12/2001)         |
| ES0000012643-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.19 | -                   | 0             | -                        | 22,71                | 17,83             | 39,000 (18/12/2001)         |
| ES0000012650-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.20 | -                   | 0             | -                        | 22,71                | 17,83             | 37,000 (18/12/2001)         |
| ES0000012668-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.21 | -                   | 0             | -                        | 22,71                | 17,83             | 35,000 (18/12/2001)         |
| ES0000012676-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.22 | -                   | 0             | -                        | 22,71                | 17,83             | 33,000 (18/12/2001)         |
| ES0000012684-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.23 | -                   | 0             | -                        | 22,71                | 17,83             | 31,000 (18/12/2001)         |
| ES0000012692-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.24 | -                   | 0             | -                        | 22,71                | 17,83             | 30,000 (18/12/2001)         |
| ES0000012700-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.25 | -                   | 0             | -                        | 22,71                | 17,83             | 28,000 (18/12/2001)         |
| ES0000012718-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.26 | -                   | 0             | -                        | 22,71                | 17,83             | 27,000 (18/12/2001)         |
| ES0000012726-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.27 | -                   | 0             | -                        | 22,71                | 17,83             | 25,000 (18/12/2001)         |
| ES0000012734-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.28 | -                   | 0             | -                        | 22,71                | 17,83             | 24,000 (18/12/2001)         |
| ES0000012742-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.29 | -                   | 0             | -                        | 22,71                | 17,83             | 23,000 (18/12/2001)         |
| ES0000012759-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.30 | -                   | 0             | -                        | 22,71                | 17,83             | 22,000 (18/12/2001)         |
| ES0000012767-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.31 | -                   | 0             | -                        | 22,71                | 17,83             | 21,000 (18/12/2001)         |
| ES0000012775-4 CUP ESTADO CUP-0 30.07.32 | -                   | 0             | -                        | 22,71                | 17,83             | 20,000 (18/12/2001)         |
| ES0L00203155-3 LET ESTADO CUP-0 15.03.02 | -                   | 0             | -                        | 1.263,89             | 758,84            | 99,784 (18/02/2002)         |
| ES0L00203288-3 LET ESTADO CUP-0 28.03.02 | -                   | 0             | -                        | 1.444,68             | 924,52            | 99,548 (05/02/2002)         |
| ES0L00204120-3 LET ESTADO CUP-0 12.04.02 | -                   | 0             | -                        | 1.032,87             | 686,15            | 99,408 (04/02/2002)         |
| ES0L00204260-3 LET ESTADO CUP-0 26.04.02 | -                   | 0             | -                        | 1.233,35             | 1.144,96          | 99,241 (30/01/2002)         |
| ES0L00205101-3 LET ESTADO CUP-0 10.05.02 | -                   | 0             | -                        | 1.349,82             | 879,44            | 98,915 (03/01/2002)         |
| ES0L00205242-3 LET ESTADO CUP-0 24.05.02 | -                   | 0             | -                        | 1.242,85             | 1.208,21          | 99,225 (25/02/2002)         |
| ES0L00206075-3 LET ESTADO CUP-0 07.06.02 | -                   | 0             | -                        | 815,89               | 733,23            | 99,105 (26/02/2002)         |
| ES0L00206216-3 LET ESTADO CUP-0 21.06.02 | -                   | 0             | -                        | 1.666,63             | 1.513,10          | 99,031 (01/03/2002)         |
| ES0L00207057-3 LET ESTADO CUP-0 05.07.02 | -                   | 0             | -                        | 1.320,81             | 1.049,21          | 98,673 (04/02/2002)         |
| ES0L00207198-3 LET ESTADO CUP-0 19.07.02 | -                   | 0             | -                        | 1.995,53             | 1.898,70          | 98,682 (20/02/2002)         |
| ES0L00208162-3 LET ESTADO CUP-0 16.08.02 | -                   | 0             | -                        | 2.294,26             | 1.338,01          | 98,435 (20/02/2002)         |
| ES0L00209137-3 LET ESTADO CUP-0 13.09.02 | -                   | 0             | -                        | 1.360,60             | 874,98            | 98,177 (20/02/2002)         |

(CONTINUA)

## V. CARACTERISTICAS DE LOS VALORES EN CIRCULACION

## 1. DEUDA DEL ESTADO

| E M I S I O N                            | FECHA PROXIMO CUPON | NUM. CUP. AÑO | CUPON CORRIDO EUR/MILLON | SALDO EN CIRCULACION | SALDO DE TERCEROS | ULTIMO PRECIO MEDIO (FECHA) |
|--|---------------------|---------------|--------------------------|----------------------|-------------------|-----------------------------|
| ES0L00210119-3 LET ESTADO CUP-0 11.10.02 | -                   | 0             | -                        | 1.836,88             | 1.360,12          | 97,903 (19/02/2002)         |
| ES0L00211083-3 LET ESTADO CUP-0 08.11.02 | -                   | 0             | -                        | 1.834,25             | 1.471,09          | 97,360 (23/01/2002)         |
| ES0L00212057-3 LET ESTADO CUP-0 05.12.02 | -                   | 0             | -                        | 3.132,21             | 2.642,26          | 97,143 (23/01/2002)         |
| ES0L00301033-3 LET ESTADO CUP-0 03.01.03 | -                   | 0             | -                        | 1.166,25             | 727,60            | 97,049 (15/02/2002)         |
| ES0L00301314-3 LET ESTADO CUP-0 31.01.03 | -                   | 0             | -                        | 1.040,12             | 454,49            | 96,835 (19/02/2002)         |
| ES0L00302288-3 LET ESTADO CUP-0 28.02.03 | -                   | 0             | -                        | 3.015,56             | 2.131,17          | 96,618 (01/03/2002)         |
| ES0L00303286-3 LET ESTADO CUP-0 28.03.03 | -                   | 0             | -                        | 1.068,18             | 741,33            | 96,266 (20/02/2002)         |
| ES0L00304250-3 LET ESTADO CUP-0 25.04.03 | -                   | 0             | -                        | 806,94               | 708,38            | 95,848 (04/01/2002)         |
| ES0L00305232-3 LET ESTADO CUP-0 23.05.03 | -                   | 0             | -                        | 1.143,65             | 710,93            | 95,523 (08/01/2002)         |
| ES0L00306206-3 LET ESTADO CUP-0 20.06.03 | -                   | 0             | -                        | 1.220,66             | 651,74            | 95,277 (06/02/2002)         |
| ES0L00307188-3 LET ESTADO CUP-0 18.07.03 | -                   | 0             | -                        | 1.229,06             | 785,74            | 95,010 (12/02/2002)         |
| ES0L00308145-3 LET ESTADO CUP-0 14.08.03 | -                   | 0             | -                        | 1.307,36             | 931,38            | 94,742 (01/03/2002)         |
| T O T A L E S                            |                     |               |                          | 277.430,85           | 234.147,20        |                             |

## 2. DEUDA DE COMUNIDADES AUTONOMAS Y OTROS EMISORES

| E M I S I O N   | FECHA PROXIMO CUPON | NUM. CUP. AÑO | CUPON CORRIDO EUR/MILLON | SALDO EN CIRCULACION | SALDO DE TERCEROS | ULTIMO PRECIO MEDIO (FECHA) |
|---|---------------------|---------------|--------------------------|----------------------|-------------------|-----------------------------|
| ES0000090102-5 OBL JUNTA ANDALUCIA 13.15 30.12.07     | 30/12/2002          | 1             | 21.976,71                | 138,23               | 72,91             | 145,350 (11/01/2001)        |
| ES0000090128-5 OBL JUNTA ANDALUCIA 11.10 02.12.05     | 02/12/2002          | 1             | 27.065,75                | 168,28               | 70,89             | 131,599 (28/10/1997)        |
| ES0000090136-5 OBL JUNTA ANDALUCIA 9.20 16.11.03      | 16/11/2002          | 1             | 26.465,75                | 186,31               | 74,59             | 109,100 (11/01/2002)        |
| ES0000090169-5 BON JUNTA ANDALUCIA 12.15 19.05.02     | 19/05/2002          | 1             | 95.202,74                | 60,10                | 33,84             | 112,002 (01/06/2000)        |
| ES0000090193-5 OBL JUNTA ANDALUCIA 10.90 14.12.05     | 14/12/2002          | 1             | 22.994,52                | 311,32               | 102,64            | 124,850 (01/02/2001)        |
| ES0000090201-5 OBL JUNTA ANDALUCIA 8.75 26.08.04      | 26/08/2002          | 1             | 44.828,77                | 60,10                | 34,50             | 110,850 (10/08/2000)        |
| ES0000090235-5 OBL JUNTA ANDALUCIA 7.25 23.04.07      | 23/04/2002          | 1             | 61.972,60                | 282,24               | 98,81             | 107,660 (14/09/2000)        |
| ES0000090243-5 OBL JUNTA ANDALUCIA 6.90 16.06.17      | 16/06/2002          | 1             | 48.772,60                | 90,15                | 51,75             | 108,157 (23/02/2000)        |
| ES0000090268-5 BON JUNTA ANDALUCIA 5.50 26.02.03      | 26/02/2003          | 1             | 452,05                   | 117,50               | 92,34             | 102,680 (04/10/2001)        |
| ES0000090276-5 OBL JUNTA ANDALUCIA 6.10 26.02.08      | 26/02/2003          | 1             | 501,37                   | 183,34               | 97,26             | 112,645 (26/02/1999)        |
| ES0000090284-5 OBL JUNTA ANDALUCIA 5.70 20.07.28      | 20/07/2002          | 1             | 34.980,82                | 180,15               | 180,14            | 95,957 (12/06/2000)         |
| ES0000090292-5 BON JUNTA ANDALUCIA 4.20 30.07.02      | 30/07/2002          | 1             | 24.624,66                | 198,86               | 156,97            | 100,520 (19/10/2001)        |
| ES0000090300-5 BON JUNTA ANDALUCIA 4.40 30.07.04      | 30/07/2002          | 1             | 25.797,26                | 173,27               | 148,19            | 102,200 (13/11/2001)        |
| ES0000090318-5 OBL JUNTA ANDALUCIA 5.00 30.07.09      | 30/07/2002          | 1             | 29.315,07                | 65,80                | 50,12             | 99,900 (10/01/2002)         |
| ES0000090326-5 OBL JUNTA ANDALUCIA 4.25 05.05.09      | 05/05/2002          | 1             | 34.931,51                | 409,73               | 289,90            | 88,578 (17/05/2000)         |
| ES0000090334-5 BON JUNTA ANDALUCIA 5.00 30.07.03      | 30/07/2002          | 1             | 29.315,07                | 77,10                | 61,35             | 98,260 (12/06/2000)         |
| ES0000090342-5 BON JUNTA ANDALUCIA 5.30 30.07.05      | 30/07/2002          | 1             | 31.073,97                | 88,10                | 72,66             | 97,920 (26/05/2000)         |
| ES0000090359-5 OBL JUNTA ANDALUCIA 5.75 14.07.10      | 14/07/2002          | 1             | 36.232,88                | 375,10               | 279,63            | 102,780 (08/05/2001)        |
| ES0000090367-5 BON JUNTA ANDALUCIA 5.60 17.05.04      | 17/05/2002          | 1             | 44.186,30                | 159,39               | 158,06            | 102,560 (16/07/2001)        |
| ES0000090383-5 BON JUNTA ANDALUCIA 5.00 17.07.06      | 17/07/2002          | 1             | 31.095,89                | 84,00                | 62,50             | NO HAY                      |
| ES0000090391-5 BON JUNTA ANDALUCIA 3.75 15.11.04      | 15/11/2002          | 1             | 10.890,41                | 193,00               | 163,96            | 98,510 (19/02/2002)         |
| ES0000093080-5 OBL COMUNIDAD CANARIA 9.32 16.05.02    | 16/05/2002          | 1             | 73.754,38                | 9,91                 | 4,73              | NO HAY                      |
| ES0000093098-5 OBL COMUNIDAD CANARIA 6.95 22.12.02    | 22/12/2002          | 1             | 13.138,36                | 9,38                 | 6,48              | NO HAY                      |
| ES0000093106-5 OBL COMUNIDAD CANARIA 5.10 12.07.02/03 | 12/07/2002          | 1             | 32.416,44                | 32,21                | 13,90             | NO HAY                      |
| ES0000093114-5 OBL COMUNIDAD CANARIA 1.00 18.12.02/04 | 18/12/2002          | 1             | 2.000,00                 | 30,13                | 21,06             | 88,130 (06/06/2001)         |

(CONTINUA)

## V. CARACTERISTICAS DE LOS VALORES EN CIRCULACION

## 2. DEUDA DE COMUNIDADES AUTONOMAS Y OTROS EMISORES

| E M I S I O N                                       | FECHA PROXIMO CUPON | NUM. CUP. AÑO | CUPON CORRIDO EUR/MILLON | SALDO EN CIRCULACION | SALDO DE TERCEROS | ULTIMO PRECIO MEDIO (FECHA) |
|---|---------------------|---------------|--------------------------|----------------------|-------------------|-----------------------------|
| ES0000093122-5 BON COMUNIDAD CANARIA 2.25 23.12.03  | 23/12/2002          | 1             | 4.191,78                 | 8,86                 | 5,89              | NO HAY                      |
| ES0000093130-5 OBL COMUNIDAD CANARIA 5.20 31.01.10  | 31/01/2003          | 1             | 4.131,51                 | 35,01                | 13,75             | NO HAY                      |
| ES0000093148-5 OBL COMUNIDAD CANARIA 5.75 15.10.29  | 15/10/2002          | 1             | 21.582,19                | 64,99                | 64,99             | NO HAY                      |
| ES0000093155-5 BON COMUNIDAD CANARIA 1.00 26.12.04  | 26/12/2002          | 1             | 1.780,82                 | 17,46                | 12,44             | 99,997 (24/12/1999)         |
| ES0000093163-5 OBL COMUNIDAD CANARIA 6.20 28.02.11  | 28/02/2003          | 1             | 169,86                   | 40,00                | 17,43             | NO HAY                      |
| ES0000093171-5 OBL COMUNIDAD CANARIA 6.05 20.10.15  | 20/10/2002          | 1             | 21.879,45                | 60,00                | 11,04             | NO HAY                      |
| ES0000093189-5 OBL COMUNIDAD CANARIA 1.50 26.12.05  | 26/12/2002          | 1             | 2.671,23                 | 27,05                | 16,23             | 99,920 (20/12/2000)         |
| ES0000093197-5 BON COMUNIDAD CANARIA 1.00 19.12.06  | 19/12/2002          | 1             | 1.972,60                 | 38,51                | 17,66             | NO HAY                      |
| ES0000101040-5 OBL COMUNIDAD MADRID 11.30 28.02.07  | 28/02/2003          | 1             | 309,59                   | 114,19               | 91,59             | 147,278 (16/09/1998)        |
| ES0000101073-5 OBL COMUNIDAD MADRID IND. 30.06.03   | 30/06/2002          | 2             | 5.539,14                 | 90,15                | 30,97             | 99,961 (15/02/2001)         |
| ES0000101081-5 OBL COMUNIDAD MADRID 7.50 19.01.04   | 19/01/2003          | 1             | 8.424,66                 | 60,10                | 22,24             | NO HAY                      |
| ES0000101115-5 OBL COMUNIDAD MADRID 9.41 28.02.03   | 28/02/2003          | 1             | 257,81                   | 90,15                | 12,02             | 114,048 (03/08/1999)        |
| ES0000101123-5 OBL COMUNIDAD MADRID 9.78 28.02.06   | 28/02/2003          | 1             | 267,95                   | 150,25               | 51,09             | 120,790 (28/12/2000)        |
| ES0000101156-5 OBL COMUNIDAD MADRID 6.30 23.07.07   | 23/07/2002          | 1             | 38.145,21                | 90,15                | 36,06             | 102,620 (14/09/2000)        |
| ES0000101164-5 OBL COMUNIDAD MADRID 4.39 26.03.09   | 26/03/2002          | 1             | 40.893,15                | 300,50               | 207,45            | 99,166 (31/05/1999)         |
| ES0000101172-5 OBL COMUNIDAD MADRID IND. 15.01.11   | 15/01/2003          | 1             | 4.351,25                 | 209,89               | 97,51             | 100,000 (21/02/2001)        |
| ES0000102071-5 BON COMUNIDAD MURCIA 11.70 27.12.04  | 27/12/2002          | 1             | 20.515,07                | 30,05                | 6,82              | 123,450 (07/07/2000)        |
| ES0000102089-5 OBL COMUNIDAD MURCIA 5.15 30.07.09   | 30/07/2002          | 1             | 30.194,52                | 82,34                | 60,10             | 99,864 (20/10/1998)         |
| ES0000102097-5 OBL COMUNIDAD MURCIA 5.75 31.01.10   | 31/01/2003          | 1             | 4.568,49                 | 85,19                | 35,00             | 101,138 (10/12/1999)        |
| ES0000102105-5 OBL COMUNIDAD MURCIA 6.00 29.09.15   | 29/09/2002          | 1             | 25.150,68                | 91,88                | 83,39             | NO HAY                      |
| ES0000102113-5 OBL COMUNIDAD MURCIA 4.80 30.11.11   | 30/11/2002          | 1             | 11.967,12                | 76,30                | 17,85             | 96,560 (13/02/2002)         |
| ES0000105389-5 OBL GENER. VALENCIANA CUP-0 29.11.06 | -                   | 0             | -                        | 21,04                | 12,04             | NO HAY                      |
| ES0000105637-5 OBL GENER. VALENCIANA 10.90 15.12.02 | 15/12/2002          | 1             | 22.695,89                | 337,10               | 211,28            | 106,490 (10/01/2002)        |
| ES0000105652-5 OBL GENER. VALENCIANA 6.25 15.12.07  | 15/12/2002          | 1             | 13.013,70                | 333,06               | 225,47            | 105,400 (18/06/2001)        |
| ES0000107054-5 OBL COMUNIDAD ARAGON 5.15 30.01.08   | 30/01/2003          | 1             | 4.232,88                 | 66,11                | 11,92             | 96,570 (03/11/2000)         |
| ES0000107062-5 OBL COMUNIDAD ARAGON 6.00 30.07.14   | 30/07/2002          | 1             | 35.178,08                | 69,61                | 20,78             | 105,150 (12/09/2001)        |
| ES0000107070-5 OBL COMUNIDAD ARAGON 6.15 19.07.15   | 19/07/2002          | 1             | 37.910,96                | 127,11               | 127,11            | 101,380 (24/07/2000)        |
| ES0000107088-5 OBL COMUNIDAD ARAGON 5.45 31.10.16   | 31/10/2002          | 1             | 18.067,12                | 71,00                | 27,20             | 104,615 (08/11/2001)        |
| ES0001348038-5 OBL ISLAS BALEARES 9.75 31.10.06/09  | 31/10/2002          | 1             | 32.321,92                | 90,15                | 40,35             | 128,750 (12/11/2001)        |
| ES0001348046-5 OBL ISLAS BALEARES 4.75 15.12.12     | 15/12/2002          | 1             | 9.890,41                 | 75,58                | 69,98             | 96,600 (12/05/1999)         |
| ES0001349010-5 OBL COM.AUT.CANTABRIA 5.81 31.05.06  | 31/05/2002          | 1             | 43.614,79                | 50,00                | 30,00             | 100,550 (18/07/2000)        |
| ES0001350059-5 OBL CASTILLA-LA MANCH 5.00 30.01.08  | 30/01/2003          | 1             | 4.109,59                 | 90,15                | 78,90             | 95,150 (10/03/2000)         |
| ES0001350067-5 OBL CASTILLA-LA MANCH 5.00 30.07.09  | 30/07/2002          | 1             | 29.315,07                | 18,63                | 10,57             | 96,358 (01/09/1999)         |
| ES0001350075-5 OBL CASTILLA-LA MANCH 6.00 31.01.10  | 31/01/2003          | 1             | 4.767,12                 | 79,33                | 61,71             | 108,350 (15/11/2001)        |
| ES0001350083-5 OBL CASTILLA-LA MANCH 6.00 15.07.11  | 15/07/2002          | 1             | 37.643,84                | 50,00                | 5,62              | 108,400 (20/11/2001)        |
| ES0001350091-5 CUP CASTILLA-LA MANCH 3.52 18.10.12  | 18/04/2002          | 2             | 12.971,94                | 50,00                | 46,73             | NO HAY                      |
| ES0001351073-5 OBL CASTILLA Y LEON 10.00 30.04.04   | 30/04/2002          | 1             | 83.561,64                | 96,16                | 31,35             | 115,170 (20/12/2000)        |
| ES0001351081-5 OBL CASTILLA Y LEON 6.00 17.12.07    | 17/12/2002          | 1             | 12.164,38                | 21,77                | 0,02              | 103,200 (29/05/2001)        |
| ES0001351099-5 OBL CASTILLA Y LEON 6.00 17.12.07    | 17/12/2002          | 1             | 12.164,38                | 54,90                | 54,90             | NO HAY                      |
| ES0001351107-5 OBL CASTILLA Y LEON 4.50 31.05.09    | 31/05/2002          | 1             | 33.780,82                | 54,87                | 36,78             | 99,250 (08/06/1999)         |
| ES0001351115-5 OBL CASTILLA Y LEON 5.80 04.12.10    | 04/12/2002          | 1             | 13.824,66                | 84,86                | 16,58             | NO HAY                      |
| ES0001351123-5 OBL CASTILLA Y LEON 4.75 26.11.11    | 26/11/2002          | 1             | 12.363,01                | 92,04                | 49,54             | 98,636 (26/11/2001)         |
| ES0001352055-5 OBL JUNTA GALICIA 12.80 28.12.02/07  | 28/12/2002          | 1             | 22.093,15                | 150,25               | 92,59             | 142,420 (30/11/2001)        |
| ES0001352063-5 OBL JUNTA GALICIA 9.30 30.11.03/08   | 30/11/2002          | 1             | 23.186,30                | 198,33               | 85,78             | 112,250 (09/01/2001)        |

(CONTINUA)

## V. CARACTERISTICAS DE LOS VALORES EN CIRCULACION

## 2. DEUDA DE COMUNIDADES AUTONOMAS Y OTROS EMISORES

| E M I S I O N  |                       |                  | FECHA<br>PROXIMO<br>CUPON | NUM.<br>CUP.<br>AÑO | CUPON<br>CORRIDO<br>EUR/MILLON | SALDO EN<br>CIRCULACION | SALDO DE<br>TERCEROS | ULTIMO<br>PRECIO MEDIO<br>(FECHA) |
|----------------|-----------------------|------------------|---------------------------|---------------------|--------------------------------|-------------------------|----------------------|-----------------------------------|
| ES0001352113-5 | OBL JUNTA GALICIA     | 7.81 15.11.06    | 15/11/2002                | 1                   | 22.681,10                      | 96,16                   | 92,83                | NO HAY                            |
| ES0001352121-5 | OBL JUNTA GALICIA     | 6.65 24.06.07    | 24/06/2002                | 1                   | 45.547,95                      | 102,17                  | 63,46                | 107,190 (29/05/2001)              |
| ES0001352139-5 | OBL JUNTA GALICIA     | 6.28 15.12.17    | 15/12/2002                | 1                   | 13.076,16                      | 91,19                   | 22,69                | 100,000 (15/12/1997)              |
| ES0001352147-5 | OBL JUNTA GALICIA     | 5.40 20.07.18    | 20/07/2002                | 1                   | 33.139,73                      | 183,31                  | 176,01               | 100,180 (27/11/2001)              |
| ES0001352154-5 | OBL JUNTA GALICIA     | 4.85 14.07.09    | 14/07/2002                | 1                   | 30.561,64                      | 170,00                  | 126,02               | NO HAY                            |
| ES0001352162-5 | OBL JUNTA GALICIA     | 5.80 29.11.10    | 29/11/2002                | 1                   | 14.619,18                      | 250,00                  | 208,28               | NO HAY                            |
| ES0001352170-5 | OBL JUNTA GALICIA     | 3.31 03.12.08    | 03/06/2002                | 2                   | 8.003,11                       | 200,00                  | 178,31               | 99,760 (24/12/2001)               |
| ES0001353061-5 | OBL COMUNIDAD NAVARRA | 12.35 12.05.05   | 12/05/2002                | 1                   | 99.138,36                      | 138,23                  | 82,85                | 125,540 (30/11/2001)              |
| ES0001353103-5 | OBL COMUNIDAD NAVARRA | 9.25 19.12.06    | 19/12/2002                | 1                   | 18.246,58                      | 83,87                   | 61,26                | 122,920 (17/11/1999)              |
| ES0001353111-5 | OBL COMUNIDAD NAVARRA | 6.75 11.06.07    | 11/06/2002                | 1                   | 48.636,99                      | 30,05                   | 15,47                | 108,350 (15/02/2002)              |
| ES0001353129-5 | BON COMUNIDAD NAVARRA | 5.45 27.11.02    | 27/11/2002                | 1                   | 14.035,62                      | 42,07                   | 24,06                | 101,759 (26/12/1997)              |
| ES0001353137-5 | OBL COMUNIDAD NAVARRA | 5.45 14.05.13    | 14/05/2002                | 1                   | 43.450,68                      | 90,15                   | 73,89                | 96,540 (19/12/2000)               |
| ES0001353145-5 | OBL COMUNIDAD NAVARRA | 4.60 26.11.08    | 26/11/2002                | 1                   | 11.972,60                      | 60,10                   | 41,74                | 102,377 (17/12/1998)              |
| ES0001353152-5 | BON COMUNIDAD NAVARRA | 4.77 24.11.04    | 24/11/2002                | 1                   | 12.676,44                      | 65,00                   | 64,47                | 99,461 (23/11/1999)               |
| ES0001353160-5 | OBL COMUNIDAD NAVARRA | 5.65 07.06.10    | 07/06/2002                | 1                   | 41.330,14                      | 60,00                   | 59,09                | 99,554 (23/06/2000)               |
| ES0001353178-5 | OBL COMUNIDAD NAVARRA | 5.85 16.11.15    | 16/11/2002                | 1                   | 16.828,77                      | 42,00                   | 27,15                | 99,600 (07/12/2000)               |
| ES0001353186-5 | OBL COMUNIDAD NAVARRA | 4.85 28.11.11    | 28/11/2002                | 1                   | 12.357,53                      | 30,00                   | 28,48                | 99,614 (27/11/2001)               |
| ES0002010314-5 | OBL INST.NAL.INDUST.  | 10.80 30.03.02   | 30/03/2002                | 1                   | 99.419,18                      | 150,25                  | 128,40               | 106,050 (26/02/2001)              |
| ES0200130120-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | 10.60 20.12.03   | 20/12/2002                | 1                   | 20.619,18                      | 119,32                  | 90,49                | 114,090 (26/09/2001)              |
| ES0200130153-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | 7.00 15.12.02    | 15/12/2002                | 1                   | 14.575,34                      | 5,89                    | 5,28                 | 109,717 (16/03/1998)              |
| ES0200130211-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | 10.50 28.12.05   | 28/12/2002                | 1                   | 18.123,29                      | 260,34                  | 196,30               | 121,600 (10/01/2002)              |
| ES0200130245-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | 8.75 02.12.05    | 02/12/2002                | 1                   | 21.335,62                      | 63,18                   | 52,34                | 115,850 (05/03/2001)              |
| ES0200130278-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | 6.75 02.01.07    | 02/01/2003                | 1                   | 10.726,03                      | 221,09                  | 199,73               | 107,900 (21/02/2002)              |
| ES0200130286-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | IND. 20.12.03    | 20/06/2002                | 2                   | 16.211,67                      | 60,10                   | 27,65                | 105,961 (20/07/2001)              |
| ES0200130294-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | 6.50 26.12.02    | 26/12/2002                | 1                   | 11.575,34                      | 333,11                  | 265,91               | 103,340 (19/09/2001)              |
| ES0200130302-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | 6.50 26.12.07    | 26/12/2002                | 1                   | 11.575,34                      | 41,50                   | 36,94                | 106,960 (21/12/2000)              |
| ES0200130336-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | IND. 10.04.07    | 10/04/2002                | 1                   | 42.430,55                      | 79,93                   | 54,69                | 99,478 (19/11/1999)               |
| ES0200130351-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | 6.00 07.07.07    | 07/07/2002                | 2                   | 8.784,53                       | 288,83                  | 253,62               | 105,500 (07/02/2002)              |
| ES0200130369-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | 6.75 28.12.26    | 28/12/2002                | 1                   | 11.650,68                      | 90,15                   | 55,92                | 105,220 (12/01/2000)              |
| ES0200130377-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | 5.72 01.01.03    | 01/04/2002                | 4                   | 9.372,81                       | 48,08                   | 38,08                | 99,970 (10/11/1997)               |
| ES0200130393-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | 5.00 18.12.03    | 18/12/2002                | 1                   | 10.000,00                      | 523,02                  | 405,48               | 102,180 (19/12/2001)              |
| ES0200130401-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | 5.83 20.03.13    | 20/03/2002                | 1                   | 55.265,21                      | 45,08                   | 15,03                | 95,922 (24/11/1999)               |
| ES0200130435-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | 5.00 18.12.08    | 18/12/2002                | 1                   | 10.000,00                      | 45,08                   | 41,91                | 95,924 (29/10/1999)               |
| ES0200130443-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | 3.50 21.05.08/13 | 21/05/2002                | 1                   | 27.232,88                      | 60,10                   | 41,43                | 87,700 (19/04/1999)               |
| ES0200130450-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | 4.51 27.05.08    | 27/05/2002                | 1                   | 35.941,97                      | 150,25                  | 98,08                | 99,424 (29/12/1998)               |
| ES0200130468-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | IND. 15.07.09    | 15/07/2002                | 1                   | 27.203,95                      | 60,00                   | 60,00                | NO HAY                            |
| ES0200130476-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | CUP-0 27.02.04   | -                         | 0                   | -                              | 90,00                   | 90,00                | NO HAY                            |
| ES0200130492-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | CUP-0 31.03.04   | -                         | 0                   | -                              | 94,00                   | 94,00                | NO HAY                            |
| ES0200130518-5 | OBL INST.CTO.OFICIAL  | IND. 31.05.10    | 31/05/2002                | 1                   | 37.442,66                      | 9,00                    | 0,00                 | 100,000 (31/05/2000)              |
| ES0202010007-5 | OBL INST.NAL.INDUST.  | 12.60 22.12.04   | 22/12/2002                | 1                   | 23.819,18                      | 60,10                   | 24,64                | 127,000 (21/12/2000)              |
| ES0202010015-5 | OBL INST.NAL.INDUST.  | IND. 22.12.04    | 22/06/2002                | 2                   | 6.190,83                       | 60,10                   | 54,09                | 99,630 (18/03/1997)               |
| ES0202010023-5 | OBL INST.NAL.INDUST.  | 11.30 27.04.03   | 27/04/2002                | 1                   | 95.353,42                      | 150,25                  | 117,24               | 109,700 (19/12/2001)              |
| ES0202010049-5 | OBL INST.NAL.INDUST.  | 8.64 20.12.08    | 20/12/2002                | 1                   | 16.806,58                      | 120,20                  | 97,90                | 122,050 (21/11/2001)              |

(CONTINUA)

## V. CARACTERISTICAS DE LOS VALORES EN CIRCULACION

## 2. DEUDA DE COMUNIDADES AUTONOMAS Y OTROS EMISORES

| E M I S I O N  |                       |                | FECHA<br>PROXIMO<br>CUPON | NUM.<br>CUP.<br>AÑO | CUPON<br>CORRIDO<br>EUR/MILLON | SALDO EN<br>CIRCULACION | SALDO DE<br>TERCEROS | ULTIMO<br>PRECIO MEDIO<br>(FECHA) |
|----------------|-----------------------|----------------|---------------------------|---------------------|--------------------------------|-------------------------|----------------------|-----------------------------------|
| ES0224260002-5 | OBL CORP.SID.INTEGRAL | 8.75 28.12.03  | 28/12/2002                | 1                   | 15.102,74                      | 180,30                  | 108,30               | 108,180 (22/02/2002)              |
| ES0231163033-5 | OBL R.T.V.E.          | 9.45 20.10.08  | 20/10/2002                | 1                   | 34.175,34                      | 180,30                  | 44,47                | 139,723 (23/12/1998)              |
| ES0300130194-5 | BON INST.CTO.OFICIAL  | IND. 26.11.02  | 26/11/2002                | 1                   | 9.262,50                       | 90,15                   | 59,05                | 100,150 (06/11/2001)              |
| ES05000900F0-3 | PAG JUNTA ANDALUCIA   | CUP-0 28.03.02 | -                         | 0                   | -                              | 54,29                   | 54,29                | NO HAY                            |
| ES05000900G8-3 | PAG JUNTA ANDALUCIA   | CUP-0 26.04.02 | -                         | 0                   | -                              | 53,30                   | 45,87                | 98,640 (27/11/2001)               |
| ES05000900H6-3 | PAG JUNTA ANDALUCIA   | CUP-0 31.05.02 | -                         | 0                   | -                              | 71,83                   | 68,44                | NO HAY                            |
| ES05000900I4-3 | PAG JUNTA ANDALUCIA   | CUP-0 28.06.02 | -                         | 0                   | -                              | 21,44                   | 18,43                | NO HAY                            |
| ES05000900J2-3 | PAG JUNTA ANDALUCIA   | CUP-0 26.07.02 | -                         | 0                   | -                              | 9,85                    | 9,78                 | NO HAY                            |
| ES05000900K0-3 | PAG JUNTA ANDALUCIA   | CUP-0 30.08.02 | -                         | 0                   | -                              | 10,50                   | 10,29                | NO HAY                            |
| ES05000900L8-3 | PAG JUNTA ANDALUCIA   | CUP-0 27.09.02 | -                         | 0                   | -                              | 39,50                   | 19,40                | 96,516 (21/09/2001)               |
| ES05000900M6-3 | PAG JUNTA ANDALUCIA   | CUP-0 25.10.02 | -                         | 0                   | -                              | 9,50                    | 5,24                 | 96,791 (29/10/2001)               |
| ES05000900N4-3 | PAG JUNTA ANDALUCIA   | CUP-0 29.11.02 | -                         | 0                   | -                              | 11,50                   | 11,21                | NO HAY                            |
| ES05000900O2-3 | PAG JUNTA ANDALUCIA   | CUP-0 27.12.02 | -                         | 0                   | -                              | 6,25                    | 5,75                 | NO HAY                            |
| ES05000900P9-3 | PAG JUNTA ANDALUCIA   | CUP-0 31.01.03 | -                         | 0                   | -                              | 8,00                    | 1,72                 | NO HAY                            |
| ES05000900Q7-3 | PAG JUNTA ANDALUCIA   | CUP-0 27.02.03 | -                         | 0                   | -                              | 14,00                   | 4,57                 | NO HAY                            |
| ES05000900S3-3 | PAG JUNTA ANDALUCIA   | CUP-0 25.04.03 | -                         | 0                   | -                              | 2,00                    | 2,00                 | NO HAY                            |
| ES0500093333-3 | PAG COMUNIDAD CANARIA | CUP-0 23.04.02 | -                         | 0                   | -                              | 31,30                   | 31,30                | NO HAY                            |
| ES0500093341-3 | PAG COMUNIDAD CANARIA | CUP-0 28.05.02 | -                         | 0                   | -                              | 25,00                   | 0,00                 | NO HAY                            |
| T O T A L E S  |                       |                |                           |                     |                                | 13.511,10               | 9.049,20             |                                   |

## 4. SALDOS DE VALORES DE OTROS ESTADOS DE LA UNION MONETARIA

| E M I S I O N  |       |               | SALDO EN<br>CIRCULACION | SALDO DE<br>TERCEROS | E M I S I O N  |       |               | SALDO EN<br>CIRCULACION | SALDO DE<br>TERCEROS |
|----------------|-------|---------------|-------------------------|----------------------|----------------|-------|---------------|-------------------------|----------------------|
| DE0001136935-5 | O DEU | 4.25 14.03.03 | 10,00                   | 0,00                 | IT0001244638-5 | O ITA | 4.50 15.07.03 | 335,00                  | 0,00                 |
| IT0000366937-5 | O ITA | 8.50 01.08.04 | 170,00                  | 0,00                 | IT0001305454-5 | O ITA | 3.25 01.02.04 | 85,00                   | 0,00                 |
| IT0000367497-5 | O ITA | 9.50 01.02.06 | 30,00                   | 0,00                 | IT0003080402-5 | O ITA | 5.25 01.08.11 | 10,00                   | 0,00                 |
| T O T A L E S  |       |               |                         |                      |                |       |               | 640,00                  | 0,00                 |

## VI. ANUNCIOS

## 1. PROXIMAS EMISIONES DE DEUDA DEL ESTADO

| EMISION  | FECHA<br>DESEMBOLSO<br>TITULARES | FECHA<br>DESEMBOLSO<br>PARTICUL. | FECHA<br>AMORTIZ. | LIMITE PET<br>TITULARES<br>DIA/HORA | LIMITE PET.<br>PARTICULAR<br>DIA/HORA | RESOLUCION<br>SUBASTA | TIPO<br>INTERES | PERIOD.<br>CUPON |
|--|----------------------------------|----------------------------------|-------------------|-------------------------------------|---------------------------------------|-----------------------|-----------------|------------------|
| BONOS DEL ESTADO 3 AÑOS<br>ES0000012437-5 7 TRAMO    | MARZO                            | 11.03.02                         | 08.03.02          | 31.10.04                            | 06.03/10 H                            | 05.03/13 H            | 06.03.02        | 4,65 --          |
| OBLIG. DEL ESTADO 10 AÑOS<br>ES0000012452-5 10 TRAMO | MARZO                            | 12.03.02                         | 11.03.02          | 31.10.11                            | 07.03/10 H                            | 05.03/13 H            | 07.03.02        | 5,35 --          |
| LETRAS DEL TESORO 12 MESES<br>ES0L00302288-3         | 06/02                            | 15.03.02                         | 14.03.02          | 28.02.03                            | 13.03/10,30                           | 11.03/13 H            | 13.03.02        | -- --            |
| LETRAS DEL TESORO 18 MESES<br>ES0L00309127-3         | 06/02                            | 15.03.02                         | 14.03.02          | 12.09.03                            | 13.03/10,30                           | 11.03/13 H            | 13.03.02        | -- --            |

## VI. ANUNCIOS

## 3. RESULTADOS DE EMISIONES DE DEUDA DEL ESTADO (EN MILLONES DE EUROS)

|   | FECHAS EMISION/<br>AMORTIZ.     | NOMINAL<br>COMPETI-<br>TIVO<br>SOLICIT. | NOMINAL<br>NO<br>COMPET. | NOMINAL<br>ADJUDI-<br>CADO | IMPORTE<br>ADJUDIC.<br>AL<br>MARGINAL | PRECIO<br>MARGI-<br>NAL | TIPO<br>MARGI<br>NAL | PRECIO<br>MEDIO    | TIPO<br>MEDIO  | PRIMER<br>PRECIO<br>NO<br>ACEPTADO | IMPTE.<br>SOLIC.<br>A ESE<br>PRECIO |
|---|---------------------------------|---|--------------------------|----------------------------|---------------------------------------|-------------------------|----------------------|--------------------|----------------|------------------------------------|-------------------------------------|
| BONOS DEL ESTADO 4,65<br>ES0000012437-5<br>QUINTO TRAMO 1.VTA.          | 12.03.01<br>31.10.04<br>NOVIEM  | 1.788                                   | 14                       | 887                        | 100                                   | 103,790                 | 3,281                | 103,830            | 3,267          | 103,780                            | 100                                 |
| SEXTO TRAMO 1.VTA.  | ENERO                           | 1.949                                   | 5                        | 950                        | 110                                   | 101,740                 | 3,968                | 101,765            | 3,959          | 101,730                            | 265                                 |
| BONOS DEL ESTADO 4,80<br>ES0000012445-5<br>QUINTO TRAMO 1.VTA.          | 09.04.01<br>31.10.06<br>DICBRE  | 1.575                                   | 4                        | 994                        | 225                                   | 102,930                 | 4,123                | 102,993            | 4,108          | 102,920                            | 65                                  |
| SEXTO TRAMO 1.VTA.  | FEBRERO                         | 2.412                                   | 7                        | 1.100                      | 351                                   | 101,400                 | 4,460                | 101,425            | 4,454          | 101,390                            | 175                                 |
| OBLIGAC. ESTADO 5,35<br>ES0000012452-5<br>OCTAVO TRAMO 1.VTA.<br>2.VTA. | 12.06.01<br>31.10.11<br>ENERO   | 1.785<br>188                            | 6                        | 851<br>188                 | 415                                   | 102,230                 | 5,053                | 102,255<br>102,255 | 5,050<br>5,050 | 102,220                            | 80                                  |
| NOVENO TRAMO 1.VTA.   | FEBRERO                         | 2.378                                   | 7                        | 1.048                      | 200                                   | 102,280                 | 5,044                | 102,298            | 5,042          | 102,270                            | 130                                 |
| OBLIGAC. ESTADO 4,75<br>ES0000012098-5<br>VIGEQUIN TRAMO 1.VTA.         | 07.12.98<br>30.07.14<br>OCTUBRE | 1.536                                   | 1                        | 396                        | 279                                   | 96,150                  | 5,166                | 96,161             | 5,165          | 96,110                             | 10                                  |
| VIGESEXTO TRAMO 1.VTA.  | DICBRE                          | 2.930                                   | 1                        | 260                        | 5                                     | 97,830                  | 4,982                | 97,919             | 4,972          | 97,820                             | 125                                 |
| OBLIGAC. ESTADO 5,75<br>ES0000012411-5<br>SEXTO TRAMO 1.VTA.<br>2.VTA.  | 23.01.01<br>30.07.32<br>NOVIEM  | 1.527<br>61                             | 1                        | 279<br>12                  | 78                                    | 105,300                 | 5,146                | 105,418<br>105,418 | 5,139<br>5,139 | 105,280                            | 100                                 |
| SEPTIMO TRAMO 1.VTA.<br>2.VTA.  | ENERO                           | 709<br>157                              | 1                        | 710<br>154                 | 75                                    | 102,380                 | 5,389                | 102,493<br>102,493 | 5,381<br>5,381 | 102,360                            | 35                                  |
| LETRAS TESORO 12 MESES<br>ESOL00302288-3 TRAMO 5                        | 01.03.02<br>28.02.03            | 1.469                                   | 210                      | 572                        | 125                                   | 96,555                  | 3,528                | 96,567             | 3,515          | 96,550                             | 156                                 |
| LETRAS TESORO 18 MESES<br>ESOL00308145-3 TRAMO 2                        | 01.03.02<br>14.08.03            | 1.663                                   | 179                      | 685                        | 206                                   | 94,710                  | 3,753                | 94,720             | 3,746          | 94,705                             | 150                                 |

## VII. OTROS MERCADOS

## 5. TIPOS DE CAMBIO DEL EURO AL 28/02/02 (FUENTE: BCE)

| MONEDA          | CAMBIO  |
|-----------------|---------|
| DOLAR EE.UU.    | 0,865   |
| LIBRA ESTERLINA | 0,611   |
| CORONA DANESA   | 7,431   |
| CORONA SUECA    | 9,062   |
| FRANCO SUIZO    | 1,475   |
| YEN JAPONES     | 116,070 |

## VIII. ESTADISTICAS DIARIAS

## 1. OPERACIONES POLITICA MONETARIA SEBC

|                                   | PLAZO | FECHA    | IMPORTE | TIPO<br>MEDIO | TIPO<br>MARGINAL |
|-----------------------------------|-------|----------|---------|---------------|------------------|
| SUBASTA A LARGO PLAZO             | -     | -        | -       | -             | -                |
| SUBASTA PRINCIPAL DE FINANCIACION | -     | -        | -       | -             | -                |
| FACILIDAD MARGINAL DE CREDITO     | 1 DIA | 28.02.02 | 1.599   | 4,25          | -                |
| FACILIDAD MARGINAL DE DEPOSITO    | 1 DIA | 28.02.02 | 37      | 2,25          | -                |

**VIII. ESTADISTICAS DIARIAS**

## 3. INDICE DE RENDIMIENTO DE UNA CARTERA DE DEUDA DEL ESTADO

|          | INDICE<br>TOTAL | INDICE<br>DE<br>PRECIOS | INDICE<br>DE<br>INTERESES | VIDA<br>MEDIA | DURACION |
|----------|-----------------|-------------------------|---------------------------|---------------|----------|
| 01/02/02 | 439,84          | 130,76                  | 336,38                    | 7,86          | 5,89     |
| 08/02/02 | 443,77          | 131,82                  | 336,64                    | 7,87          | 5,91     |
| 15/02/02 | 441,21          | 130,93                  | 337,00                    | 7,81          | 5,85     |
| 22/02/02 | 442,64          | 131,24                  | 337,29                    | 7,80          | 5,85     |
| 25/02/02 | 441,55          | 130,86                  | 337,41                    | 7,78          | 5,82     |
| 26/02/02 | 441,41          | 130,81                  | 337,45                    | 7,78          | 5,82     |
| 27/02/02 | 442,11          | 130,99                  | 337,50                    | 7,78          | 5,82     |
| 28/02/02 | 442,09          | 130,97                  | 337,55                    | 7,78          | 5,82     |

NOTAS: LOS CRITERIOS Y METODO APLICADOS EN LA ELABORACION DE LOS INDICES ESTAN EXPUESTOS EN EL BOLETIN ECONOMICO DEL BANCO DE ESPAÑA DE MAYO DE 1.991  
LA BASE DE LOS INDICES ES 100 A DICIEMBRE DE 1.987