



## I. MERCADO DE DINERO

### 1. DEPOSITOS INTERBANCARIOS

| PLAZOS       | IMPORTE<br>NEGOCIADO | TIPOS DE INTERES |        |        | OPER. VIVAS<br>POR PLAZOS<br>RESIDUALES |
|--------------|----------------------|------------------|--------|--------|---|
|              |                      | MEDIO            | MAXIMO | MINIMO |   |
| DIA A DIA    | 3.386,95             | 1,35             | 1,80   | 0,80   | 11.174,18                               |
| 2 A 5 DIAS   | 100,00               | 1,45             | 1,45   | 1,45   | 448,16                                  |
| UNA SEMANA   | 550,00               | 1,54             | 1,95   | 1,00   | 1.346,09                                |
| QUINCE DIAS  | 5,00                 | 1,70             | 1,70   | 1,70   | 125,06                                  |
| 18-26 DIAS   | -                    | -                | -      | -      | 46,03                                   |
| UN MES       | 35,00                | 1,35             | 1,35   | 1,35   | 539,82                                  |
| 1 A 2 MESES  | -                    | -                | -      | -      | 41,64                                   |
| DOS MESES    | -                    | -                | -      | -      | 14,23                                   |
| 2 A 3 MESES  | -                    | -                | -      | -      | 7,47                                    |
| TRES MESES   | -                    | -                | -      | -      | 2,32                                    |
| 3 A 6 MESES  | -                    | -                | -      | -      | 30,36                                   |
| SEIS MESES   | -                    | -                | -      | -      | 6,64                                    |
| 6 A 12 MESES | -                    | -                | -      | -      | -                                       |
| UN AÑO       | -                    | -                | -      | -      | -                                       |
| MAS DE 1 AÑO | -                    | -                | -      | -      | -                                       |
| TOTAL        | 4.076,95             |                  |        |        | 13.782,00                               |

## II. MERCADO DE DIVISAS

### 1. TIPOS DE CAMBIO OFICIALES DEL EURO (Fecha: 13 de Octubre de 2011)

| MONEDA |                  | CAMBIO<br>(1 EUR =) |
|--------|------------------|---------------------|
| USD    | Dólar USA        | 1.3727              |
| JPY    | Yen japonés      | 105.48              |
| CZK    | Corona checa     | 24.746              |
| DKK    | Corona danesa    | 7.4450              |
| EEK    | Corona estonia   | -                   |
| GBP    | Libra esterlina  | 0.87585             |
| HUF    | Forint húngaro   | 291.80              |
| LTL    | Lita lituana     | 3.4528              |
| LVL    | Lat Letón        | 0.7055              |
| PLN    | Zloty polaco     | 4.3168              |
| SEK    | Corona sueca     | 9.1374              |
| CHF    | Franco suizo     | 1.2335              |
| ISK    | Corona islandesa | -                   |

(Continúa)

## II. MERCADO DE DIVISAS

### 1. TIPOS DE CAMBIO OFICIALES DEL EURO (Fecha: 13 de Octubre de 2011)

| MONEDA |                     | CAMBIO<br>(1 EUR =) |
|--------|---------------------|---------------------|
| NOK    | Corona noruega      | 7.7570              |
| BGN    | Lev búlgaro         | 1.9558              |
| HRK    | Kuna croata         | 7.4808              |
| RON    | Leu rumano          | 4.3203              |
| RUB    | Rublo ruso          | 42.9275             |
| TRY    | Nueva lira turca    | 2.5174              |
| AUD    | Dólar australiano   | 1.3536              |
| CAD    | Dólar canadiense    | 1.4030              |
| CNY    | Yuan renminbi chino | 8.7580              |
| HKD    | Dólar de Hong-Kong  | 10.6792             |
| IDR    | Rupia indonesia     | 12179.44            |
| KRW    | Won surcoreano      | 1591.54             |
| MYR    | Ringgit malasio     | 4.3096              |
| NZD    | Dólar neozelandés   | 1.7352              |
| PHP    | Peso filipino       | 59.552              |
| SGD    | Dólar de Singapur   | 1.7560              |
| THB    | Baht tailandés      | 42.320              |
| ZAR    | Rand sudafricano    | 10.8297             |
| BRL    | Real brasileño      | 2.4217              |
| MXN    | Peso mexicano       | 18.3118             |
| INR    | Rupia india         | 67.4410             |

Cambios del euro publicados por el Banco Central Europeo, que tendrán la consideración de cambios oficiales de acuerdo con lo dispuesto en el artículo 36 de la Ley 46/1988, de 17 de diciembre, sobre la introducción del euro.

## III. MERCADO PRIMARIO DE DEUDA PUBLICA

### 1. PROXIMAS EMISIONES DE DEUDA PUBLICA

| DENOMINACION            | CODIGO ISIN  | TRAMO | FECHA AMORTIZ. | TIPO INTS. | FECHA RESOLUC. SUBASTA | LIMITE PETICIONES PARTICULARES DIA/HORA | LIMITE PETICIONES TITULARES DIA/HORA | FECHA DESEMB. PARTIC. | FECHA DESEMB. TITULAR | COMUNIC BANCO ESPAÑA |
|-------------------------|--------------|-------|----------------|------------|------------------------|---|--------------------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|
| Letras Tesoro 3 meses   | ES0L01201208 | 3     | 20.01.12       |            | 25.10.11               | 24.10 14:00                             | 25.10 10:00                          | 27.10.11              | 28.10.11              | 08/11                |
| Letras Tesoro 6 meses   | ES0L01204202 | 4     | 20.04.12       |            | 25.10.11               | 24.10 14:00                             | 25.10 10:00                          | 27.10.11              | 28.10.11              | 08/11                |
| Letras Tesoro 12 meses  | ES0L01210191 | 3     | 19.10.12       |            | 18.10.11               | 17.10 14:00                             | 18.10 10:00                          | 20.10.11              | 21.10.11              | 08/11                |
| Letras Tesoro 18 meses  | ES0L01304192 | 1     | 19.04.13       |            | 18.10.11               | 17.10 14:00                             | 18.10 10:00                          | 20.10.11              | 21.10.11              | 08/11                |
| Bonos del Estado 3 años | ES00000123D5 | 4     | 30.04.14       | 3,40       | 06.10.11               | 05.10 14:00                             | 06.10 10:00                          | 10.10.11              | 11.10.11              | 85/11                |

(Continúa)

### III. MERCADO PRIMARIO DE DEUDA PUBLICA

#### 1. PROXIMAS EMISIONES DE DEUDA PUBLICA

| DENOMINACION            | CODIGO ISIN  | TRAMO | FECHA AMORTIZ. | TIPO INTS. | FECHA RESOLUC. SUBASTA | LIMITE PETICIONES PARTICULARES DIA/HORA | LIMITE PETICIONES TITULARES DIA/HORA | FECHA DESEMB. PARTIC. | FECHA DESEMB. TITULAR | COMUNIC BANCO ESPAÑA |
|-------------------------|--------------|-------|----------------|------------|------------------------|---|--------------------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|
| Bonos del Estado 3 años | ES00000121P3 | 6     | 31.10.14       | 3,30       | 06.10.11               | 05.10 14:00                             | 06.10 10:00                          | 10.10.11              | 11.10.11              | 89/11                |
| Bonos del Estado 3 años | ES00000122F2 | 6     | 30.04.15       | 3,00       | 06.10.11               | 05.10 14:00                             | 06.10 10:00                          | 10.10.11              | 11.10.11              | 89/11                |
| Pag. Andalucía 3 meses  | ES05000904T3 | 6     | 27.01.12       |            | 25.10.11               |   | 25.10 10:30                          |                       | 28.10.11              | 03/11                |
| Pag. Andalucía 6 meses  | ES05000904W7 | 5     | 27.04.12       |            | 25.10.11               |   | 25.10 10:30                          |                       | 28.10.11              | 03/11                |
| Pag. Andalucía 9 meses  | ES05000904Z0 | 3     | 27.07.12       |            | 25.10.11               |   | 25.10 10:30                          |                       | 28.10.11              | 03/11                |
| Pag. Andalucía 12 meses | ES05000905C6 | 2     | 26.10.12       |            | 25.10.11               |   | 25.10 10:30                          |                       | 28.10.11              | 03/11                |
| Pag. Andalucía 18 meses | ES05000905I3 | 1     | 26.04.13       |            | 25.10.11               |   | 25.10 10:30                          |                       | 28.10.11              | 03/11                |

#### 2. RESULTADOS DE EMISIONES DE DEUDA PUBLICA

| DENOMINACION                              | FECHA EMISION | FECHA AMORTIZ. | TRAM - VTA. | NOMINAL SOLICITADO |       | NOMINAL ADJUDICADO |        | PRECIO MARGI- NAL | TIPO MARGI- NAL | PRECIO MEDIO | TIPO MEDIO | PRIMER PRECIO NO ADM. | IMPTE. A ESE PRECIO |
|---|---------------|----------------|-------------|--------------------|-------|--------------------|--------|-------------------|-----------------|--------------|------------|-----------------------|---------------------|
|   |               |                |             | COMPET             | NO C. | TOTAL              | AL MRG |                   |                 |              |            |                       |                     |
| Bonos del Estado ES00000121P3 BON 3.30    | 11.10.11      | 31.10.14       | 6/1         | 1.980              | 1     | 981                | 25     | 99,370            | 3,520           | 99,440       | 3,495      | 99,350                | 120                 |
| Bonos del Estado ES00000122F2 BON 3.00    | 11.10.11      | 30.04.15       | 6/1         | 2.320              | 0     | 1.120              | 195    | 97,820            | 3,663           | 97,896       | 3,639      | 97,810                | 25                  |
| Bonos del Estado ES00000123D5 BON 3.40    | 11.10.11      | 30.04.14       | 4/1         | 4.253              | 13    | 2.398              | 235    | 99,430            | 3,633           | 99,535       | 3,589      | 99,410                | 25                  |
| Bonos del Estado ES00000123J2 BON 4.25    | 06.09.11      | 31.10.16       | 1/1         | 6.047              | 315   | 3.621              | 255    | 98,800            | 4,519           | 98,932       | 4,489      | 98,790                | 40                  |
| Obligaciones Estado ES00000121L2 OBL 4.60 | 20.09.11      | 30.07.19       | 4/1         | 2.213              | 2     | 1.022              | 10     | 97,450            | 4,999           | 97,634       | 4,969      | 97,420                | 40                  |
| Obligaciones Estado ES00000122D7 OBL 4.00 | 20.09.11      | 30.04.20       | 5/1         | 2.805              | 1     | 1.396              | 25     | 92,790            | 5,050           | 93,077       | 5,007      | 92,760                | 25                  |
| Obligaciones Estado ES00000122T3 OBL 4.85 | 20.09.11      | 31.10.20       | 6/1         | 3.037              | 7     | 1.532              | 50     | 97,510            | 5,195           | 97,782       | 5,156      | 97,500                | 25                  |
| Obligaciones Estado ES00000123C7 OBL 5.90 | 26.07.11      | 30.07.26       | 3/1         | 1.688              | 6     | 814                | 20     | 96,950            | 6,218           | 97,205       | 6,191      | 96,900                | 155                 |
| Obligaciones Estado ES00000121S7 OBL 4.70 | 24.05.11      | 30.07.41       | 7/1         | 1.423              | 0     | 724                | 105    | 81,910            | 6,011           | 82,013       | 6,002      | 81,900                | 10                  |
| Letras del Tesoro ES0L01112165 LET 3 m.   | 30.09.11      | 16.12.11       | 5/1         | 3.961              | 8     | 1.604              | 100    | 99,627            | 1,749           | 99,639       | 1,692      | 99,627                | 20                  |
| Letras del Tesoro ES0L01203238 LET 6 m.   | 30.09.11      | 23.03.12       | 2/1         | 6.305              | 106   | 1.621              | 105    | 98,690            | 2,730           | 98,721       | 2,665      | 98,687                | 150                 |
| Letras del Tesoro ES0L01209219 LET 12 m.  | 23.09.11      | 21.09.12       | 1/1         | 9.910              | 58    | 3.587              | 65     | 96,442            | 3,648           | 96,496       | 3,591      | 96,441                | 30                  |
| Letras del Tesoro ES0L01302154 LET 18 m.  | 23.09.11      | 15.02.13       | 2/1         | 2.361              | 21    | 870                | 235    | 94,714            | 3,900           | 94,834       | 3,807      | 94,662                | 0                   |



**III. MERCADO PRIMARIO DE DEUDA PUBLICA**

**3. ANUNCIOS**

ASUNTO: COMUNICACIONES 91/11 DEL DEPARTAMENTO DE OPERACIONES  
-----

El Departamento de Operaciones, ha emitido la Comunicación de referencia disponible en INTERNET, en la dirección <http://www.bde.es>, en la Sección de Sistemas de Pago "Mercado de Deuda Pública/Comunicaciones".