



## 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    | 3.878,20             | 0,95             | 1,78   | 0,55   | 19.747,04                               |
| 2 A 5 DIAS   | 80,00                | 1,20             | 1,20   | 1,20   | 1.485,02                                |
| UNA SEMANA   | 100,00               | 1,43             | 1,60   | 1,25   | 90,06                                   |
| QUINCE DIAS  | 30,00                | 1,35             | 1,35   | 1,35   | 119,54                                  |
| 18-26 DIAS   | 8,00                 | 0,75             | 0,75   | 0,75   | 59,39                                   |
| UN MES       | -                    | -                | -      | -      | 2,32                                    |
| 1 A 2 MESES  | -                    | -                | -      | -      | 5,76                                    |
| DOS MESES    | -                    | -                | -      | -      | 13,12                                   |
| 2 A 3 MESES  | -                    | -                | -      | -      | 20,00                                   |
| TRES MESES   | -                    | -                | -      | -      | -                                       |
| 3 A 6 MESES  | -                    | -                | -      | -      | 24,70                                   |
| SEIS MESES   | -                    | -                | -      | -      | -                                       |
| 6 A 12 MESES | -                    | -                | -      | -      | -                                       |
| UN AÑO       | -                    | -                | -      | -      | -                                       |
| MAS DE 1 AÑO | -                    | -                | -      | -      | -                                       |
| TOTAL        | 4.096,20             |                  |        |        | 21.566,94                               |

## II. MERCADO DE DIVISAS

### 1. TIPOS DE CAMBIO OFICIALES DEL EURO (Fecha: 12 de Diciembre de 2011)

| MONEDA |                  | CAMBIO<br>(1 EUR =) |
|--------|------------------|---------------------|
| USD    | Dólar USA        | 1.3251              |
| JPY    | Yen japonés      | 103.12              |
| CZK    | Corona checa     | 25.578              |
| DKK    | Corona danesa    | 7.4361              |
| EEK    | Corona estonia   | -                   |
| GBP    | Libra esterlina  | 0.84800             |
| HUF    | Forint húngaro   | 305.16              |
| LTL    | Lita lituana     | 3.4528              |
| LVL    | Lat Letón        | 0.6979              |
| PLN    | Zloty polaco     | 4.5395              |
| SEK    | Corona sueca     | 9.0525              |
| CHF    | Franco suizo     | 1.2349              |
| ISK    | Corona islandesa | -                   |

(Continúa)

## II. MERCADO DE DIVISAS

### 1. TIPOS DE CAMBIO OFICIALES DEL EURO (Fecha: 12 de Diciembre de 2011)

| MONEDA |                     | CAMBIO<br>(1 EUR =) |
|--------|---------------------|---------------------|
| NOK    | Corona noruega      | 7.7015              |
| BGN    | Lev búlgaro         | 1.9558              |
| HRK    | Kuna croata         | 7.4975              |
| RON    | Leu rumano          | 4.3491              |
| RUB    | Rublo ruso          | 41.8289             |
| TRY    | Nueva lira turca    | 2.4687              |
| AUD    | Dólar australiano   | 1.3104              |
| CAD    | Dólar canadiense    | 1.3576              |
| CNY    | Yuan renminbi chino | 8.4284              |
| HKD    | Dólar de Hong-Kong  | 10.3109             |
| IDR    | Rupia indonesia     | 11987.73            |
| KRW    | Won surcoreano      | 1523.48             |
| MYR    | Ringgit malasio     | 4.1946              |
| NZD    | Dólar neozelandés   | 1.7293              |
| PHP    | Peso filipino       | 57.842              |
| SGD    | Dólar de Singapur   | 1.7193              |
| THB    | Baht tailandés      | 41.277              |
| ZAR    | Rand sudafricano    | 10.9105             |
| BRL    | Real brasileño      | 2.4068              |
| MXN    | Peso mexicano       | 18.2660             |
| INR    | Rupia india         | 70.0470             |

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<br>ISIN | TRA<br>MO | FECHA<br>AMORTIZ. | TIPO<br>INTS. | FECHA<br>RESOLUC.<br>SUBASTA | LIMITE<br>PETICIONES<br>PARTICULARES<br>DIA/HORA | LIMITE<br>PETICIONES<br>TITULARES<br>DIA/HORA | FECHA<br>DESEMB.<br>PARTIC. | FECHA<br>DESEMB.<br>TITULAR | COMUNIC<br>BANCO<br>ESPAÑA |
|-------------------------|----------------|-----------|-------------------|---------------|------------------------------|--|---|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|
| Letras Tesoro 3 meses   | ES0L01203238   | 3         | 23.03.12          |               | 20.12.11                     | 19.12 14:00                                      | 20.12 10:00                                   | 22.12.11                    | 23.12.11                    | 08/11                      |
| Letras Tesoro 6 meses   | ES0L01206223   | 4         | 22.06.12          |               | 20.12.11                     | 19.12 14:00                                      | 20.12 10:00                                   | 22.12.11                    | 23.12.11                    | 08/11                      |
| Letras Tesoro 12 meses  | ES0L01212148   | 3         | 14.12.12          |               | 13.12.11                     | 12.12 14:00                                      | 13.12 10:00                                   | 15.12.11                    | 16.12.11                    | 08/11                      |
| Letras Tesoro 18 meses  | ES0L01306213   | 1         | 21.06.13          |               | 13.12.11                     | 12.12 14:00                                      | 13.12 10:00                                   | 15.12.11                    | 16.12.11                    | 08/11                      |
| oblig. Estado a 10 años | ES00000122D7   | 7         | 30.04.20          | 4,00          | 15.12.11                     | 14.12 14:00                                      | 15.12 10:00                                   | 19.12.11                    | 20.12.11                    | 109/11                     |

(Continúa)

### III. MERCADO PRIMARIO DE DEUDA PÚBLICA

#### 1. PROXIMAS EMISIONES DE DEUDA PÚBLICA

| 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 |
|-------------------------|--------------|-------|----------------|------------|------------------------|---|--------------------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|
| Oblig. Estado a 10 años | ES00000123B9 | 8     | 30.04.21       | 5,50       | 15.12.11               | 14.12 14:00                             | 15.12 10:00                          | 19.12.11              | 20.12.11              | 111/11               |
| Oblig. Estado a 10 años | ES00000120G4 | 11    | 31.01.16       | 3,15       | 15.12.11               | 14.12 14:00                             | 15.12 10:00                          | 19.12.11              | 20.12.11              | 111/11               |
| Pag. Andalucía 3 meses  | ES05000904V9 | 6     | 30.03.12       |            | 27.12.11               |   | 27.12 10:30                          |                       | 30.12.11              | 03/11                |
| Pag. Andalucía 6 meses  | ES05000904X5 | 5     | 29.06.12       |            | 27.12.11               |   | 27.12 10:30                          |                       | 30.12.11              | 03/11                |
| Pag. Andalucía 9 meses  | ES05000905B8 | 3     | 28.09.12       |            | 27.12.11               |   | 27.12 10:30                          |                       | 30.12.11              | 03/11                |
| Pag. Andalucía 12 meses | ES05000905E2 | 2     | 28.12.12       |            | 27.12.11               |   | 27.12 10:30                          |                       | 30.12.11              | 03/11                |
| Pag. Andalucía 18 meses | ES05000905K9 | 1     | 28.06.13       |            | 27.12.11               |   | 27.12 10:30                          |                       | 30.12.11              | 03/11                |

#### 2. RESULTADOS DE EMISIONES DE DEUDA PÚBLICA

| 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 ES00000122F2 BON 3.00    | 06.12.11      | 30.04.15       | 7/1         | 2.933              | 308   | 1.200              | 639    | 93,280           | 5,203          | 93,325       | 5,188      | 93,260                | 40                  |
| Obligaciones Estado ES00000120G4 OBL 3.15 | 06.12.11      | 31.01.16       | 10/1        | 3.101              | 152   | 1.150              | 795    | 92,210           | 5,281          | 92,224       | 5,277      | 92,180                | 59                  |
| Obligaciones Estado ES00000120J8 OBL 3.80 | 06.12.11      | 31.01.17       | 8/1         | 3.608              | 153   | 1.400              | 652    | 92,280           | 5,560          | 92,344       | 5,545      | 92,250                | 75                  |
| Obligaciones Estado ES00000123K0 OBL 5.85 | 22.11.11      | 31.01.22       | 1/1         | 5.488              | 14    | 3.563              | 80     | 91,250           | 7,089          | 92,007       | 6,976      | 91,170                | 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                 |
| Letras del Tesoro ES0L01202172 LET 3 m.   | 25.11.11      | 17.02.12       | 5/1         | 5.728              | 10    | 2.012              | 200    | 98,796           | 5,220          | 98,821       | 5,110      | 98,792                | 120                 |
| Letras del Tesoro ES0L01205183 LET 6 m.   | 25.11.11      | 18.05.12       | 2/1         | 4.720              | 32    | 966                | 25     | 97,475           | 5,328          | 97,522       | 5,227      | 97,474                | 110                 |
| Letras del Tesoro ES0L01211231 LET 12 m.  | 18.11.11      | 23.11.12       | 1/1         | 5.223              | 303   | 2.600              | 60     | 94,909           | 5,200          | 95,075       | 5,022      | 94,863                | 155                 |
| Letras del Tesoro ES0L01304192 LET 18 m.  | 18.11.11      | 19.04.13       | 2/1         | 3.299              | 24    | 558                | 75     | 92,813           | 5,320          | 93,017       | 5,159      | 92,787                | 15                  |

#### 3. ANUNCIOS

ASUNTO: COMUNICACION 111/11 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".