



## 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    | 6.567,50             | 0,40             | 0,70   | 0,25   | 21.333,68                               |
| 2 A 5 DIAS   | -                    | -                | -      | -      | 834,59                                  |
| UNA SEMANA   | 201,00               | 0,62             | 1,00   | 0,36   | 180,34                                  |
| QUINCE DIAS  | -                    | -                | -      | -      | 256,74                                  |
| 18-26 DIAS   | 20,00                | 1,00             | 1,00   | 1,00   | 335,33                                  |
| UN MES       | -                    | -                | -      | -      | 200,11                                  |
| 1 A 2 MESES  | -                    | -                | -      | -      | 525,94                                  |
| DOS MESES    | -                    | -                | -      | -      | 16,43                                   |
| 2 A 3 MESES  | -                    | -                | -      | -      | 12,48                                   |
| TRES MESES   | -                    | -                | -      | -      | 10,16                                   |
| 3 A 6 MESES  | -                    | -                | -      | -      | 7,09                                    |
| SEIS MESES   | -                    | -                | -      | -      | 1,24                                    |
| 6 A 12 MESES | -                    | -                | -      | -      | -                                       |
| UN AÑO       | -                    | -                | -      | -      | -                                       |
| MAS DE 1 AÑO | -                    | -                | -      | -      | -                                       |
| TOTAL        | 6.788,50             |                  |        |        | 23.714,14                               |

## II. MERCADO DE DIVISAS

### 1. TIPOS DE CAMBIO OFICIALES DEL EURO (Fecha: 21 de Febrero de 2012)

| MONEDA |                  | CAMBIO<br>(1 EUR =) |
|--------|------------------|---------------------|
| USD    | Dólar USA        | 1.3222              |
| JPY    | Yen japonés      | 105.38              |
| CZK    | Corona checa     | 24.912              |
| DKK    | Corona danesa    | 7.4358              |
| EEK    | Corona estonia   | -                   |
| GBP    | Libra esterlina  | 0.83640             |
| HUF    | Forint húngaro   | 288.03              |
| LTL    | Lita lituana     | 3.4528              |
| LVL    | Lat Letón        | 0.6977              |
| PLN    | Zloty polaco     | 4.1837              |
| SEK    | Corona sueca     | 8.8107              |
| CHF    | Franco suizo     | 1.2073              |
| ISK    | Corona islandesa | -                   |

(Continúa)

## II. MERCADO DE DIVISAS

### 1. TIPOS DE CAMBIO OFICIALES DEL EURO (Fecha: 21 de Febrero de 2012)

| MONEDA |                     | CAMBIO<br>(1 EUR =) |
|--------|---------------------|---------------------|
| NOK    | Corona noruega      | 7.5200              |
| BGN    | Lev búlgaro         | 1.9558              |
| HRK    | Kuna croata         | 7.5820              |
| RON    | Leu rumano          | 4.3565              |
| RUB    | Rublo ruso          | 39.4500             |
| TRY    | Nueva lira turca    | 2.3182              |
| AUD    | Dólar australiano   | 1.2385              |
| CAD    | Dólar canadiense    | 1.3172              |
| CNY    | Yuan renminbi chino | 8.3258              |
| HKD    | Dólar de Hong-Kong  | 10.2547             |
| IDR    | Rupia indonesia     | 11888.20            |
| KRW    | Won surcoreano      | 1488.88             |
| MYR    | Ringgit malasio     | 3.9997              |
| NZD    | Dólar neozelandés   | 1.5839              |
| PHP    | Peso filipino       | 56.421              |
| SGD    | Dólar de Singapur   | 1.6613              |
| THB    | Baht tailandés      | 40.671              |
| ZAR    | Rand sudafricano    | 10.2166             |
| BRL    | Real brasileño      | 2.2670              |
| MXN    | Peso mexicano       | 16.8286             |
| INR    | Rupia india         | 65.2240             |

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  | ES0L01205183 | 3     | 18.05.12       |            | 21.02.12               | 20.02 14:00                             | 21.02 10:00                          | 23.02.12              | 24.02.12              | 08/12                |
| Letras Tesoro 6 meses  | ES0L01208245 | 4     | 24.08.12       |            | 21.02.12               | 20.02 14:00                             | 21.02 10:00                          | 23.02.12              | 24.02.12              | 08/12                |
| Letras Tesoro 12 meses | ES0L01302154 | 3     | 15.03.13       |            | 14.02.12               | 13.02 14:00                             | 14.02 10:00                          | 16.02.12              | 17.02.12              | 08/12                |
| Letras Tesoro 18 meses | ES0L01308235 | 1     | 23.08.13       |            | 14.02.12               | 13.02 14:00                             | 14.02 10:00                          | 16.02.12              | 17.02.12              | 08/12                |
| Bonos Estado 3 años    | ES00000123L8 | 2     | 30.07.15       | 4.00       | 02.02.12               | 01.02 14:00                             | 02.02 10:00                          | 06.02.12              | 07.02.12              | 06/12                |

(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 Estado 5 años     | ES00000123J2 | 5     | 31.10.16       | 4.25       | 02.02.12               | 01.02 14:00                             | 02.02 10:00                          | 06.02.12              | 07.02.12              | 06/12                |
| Bonos Estado 3 años     | ES00000123L8 | 3     | 30.07.15       | 4.00       | 16.02.12               | 15.02 14:00                             | 16.02 10:00                          | 20.02.12              | 21.02.12              | 16/12                |
| Obliga. Estado 10 años  | ES0000012916 | 10    | 31.01.15       | 4.40       | 16.02.12               | 15.02 14:00                             | 16.02 10:00                          | 20.02.12              | 21.02.12              | 16/12                |
| Obliga. Estado 10 años  | ES0000012106 | 6     | 31.10.19       | 4.30       | 16.02.12               | 15.02 14:00                             | 16.02 10:00                          | 20.02.12              | 21.02.12              | 16/12                |
| Pag. Andalucía 3 meses  | ES05000904X5 | 6     | 25.05.12       |            | 21.02.12               |   | 21.02 10:30                          |                       | 24.02.12              | 03/12                |
| Pag. Andalucía 6 meses  | ES05000904A0 | 4     | 31.08.12       |            | 21.02.12               |   | 21.02 10:30                          |                       | 24.02.12              | 03/12                |
| Pag. Andalucía 9 meses  | ES0500090D40 | 3     | 30.11.12       |            | 21.02.12               |   | 21.02 10:30                          |                       | 24.02.12              | 03/12                |
| Pag. Andalucía 12 meses | ES05000905G7 | 2     | 22.02.13       |            | 21.02.12               |   | 21.02 10:30                          |                       | 24.02.12              | 03/12                |
| Pag. Andalucía 18 meses | ES05000905M5 | 1     | 30.08.13       |            | 21.02.12               |   | 21.02 10:30                          |                       | 24.02.12              | 03/12                |

#### 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 ES00000123L8 BON 4.00    | 21.02.12      | 30.07.15       | 3/1         | 4.976              | 1     | 2.268              | 198    | 101,700          | 3,471          | 102,147      | 3,333      | 101,680               | 15                  |
| Obligaciones Estado ES0000012916 OBL 4.40 | 21.02.12      | 31.01.15       | 10/1        | 3.203              | 0     | 733                | 160    | 103,510          | 3,127          | 103,967      | 2,966      | 103,500               | 155                 |
| Obligaciones Estado ES00000120J8 OBL 3.80 | 07.02.12      | 31.01.17       | 9/1         | 2.848              | 1     | 1.054              | 100    | 100,430          | 3,704          | 101,053      | 3,566      | 100,400               | 25                  |
| Bonos del Estado ES00000123J2 BON 4.25    | 07.02.12      | 31.10.16       | 5/1         | 3.511              | 1     | 984                | 25     | 102,950          | 3,558          | 103,397      | 3,456      | 102,910               | 170                 |
| Obligaciones Estado ES0000012106 OBL 4.30 | 21.02.12      | 31.10.19       | 6/1         | 3.509              | 2     | 1.073              | 110    | 96,210           | 4,899          | 96,620       | 4,833      | 96,200                | 80                  |
| Letras del Tesoro ES0L01205183 LET 3 m.   | 24.02.12      | 18.05.12       | 3/1         | 7.002              | 6     | 1.736              | 500    | 99,897           | 0,440          | 99,907       | 0,396      | 99,896                | 25                  |
| Letras del Tesoro ES0L01208245 LET 6 m.   | 24.02.12      | 24.08.12       | 4/1         | 7.819              | 8     | 764                | 456    | 99,607           | 0,780          | 99,615       | 0,764      | 99,602                | 25                  |
| Letras del Tesoro ES0L01302154 LET 12 m.  | 17.02.12      | 15.02.13       | 3/1         | 6.478              | 203   | 2.943              | 175    | 98,067           | 1,949          | 98,116       | 1,899      | 98,066                | 195                 |
| Letras del Tesoro ES0L01308235 LET 18 m.  | 17.02.12      | 23.08.13       | 1/1         | 7.176              | 30    | 2.503              | 225    | 96,429           | 2,395          | 96,555       | 2,308      | 96,422                | 345                 |
| JUNTA ANDALUCIA ES05000904X5 PAG CUP-0    | 24.02.12      | 25.05.12       | 6/1         | 21                 |       | 20                 | 6      | 99,120           | 3,512          | 99,213       | 3,138      | 99,035                | 1                   |
| JUNTA ANDALUCIA ES05000905A0 PAG CUP-0    | 24.02.12      | 31.08.12       | 4/1         | 5                  |       | 5                  | 5      | 98,070           | 3,749          | 98,070       | 3,749      |                       |                     |



**III. MERCADO PRIMARIO DE DEUDA PUBLICA**

**3. ANUNCIOS**

ASUNTO: COMUNICACION 16/12 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".