

III. OTRAS DISPOSICIONES

MINISTERIO DE ECONOMÍA Y HACIENDA

3837 Orden EHA/399/2011, de 24 de febrero, por la que se aprueba la relación de valores negociados en mercados organizados, con su valor de negociación medio correspondiente al cuarto trimestre de 2010, a efectos de la declaración informativa anual acerca de valores, seguros y rentas.

El artículo 39 del Reglamento General de las actuaciones y los procedimientos de gestión e inspección tributaria y de desarrollo de las normas comunes de los procedimientos de aplicación de los tributos, aprobado por Real Decreto 1065/2007, de 27 de julio, establece la obligación de suministro de información, entre otras, de las entidades que sean depositarias de valores mobiliarios, de presentar una declaración informativa anual sobre la valoración de las acciones y participaciones en el capital o en los fondos propios de entidades jurídicas y de los valores representativos de la cesión a terceros de capitales propios, negociados ambos en mercados organizados.

La citada obligación de información ha sido objeto de desarrollo por la Orden EHA/3481/2008, de 1 de diciembre, por la que se aprueba el modelo 189 de declaración informativa anual acerca de valores, seguros y rentas, los diseños físicos y lógicos para la sustitución de las hojas interiores de dicho modelo por soportes directamente legibles por ordenador y se establecen las condiciones y el procedimiento para su presentación telemática.

A tal efecto, es necesario publicar una relación de los valores que se hayan negociado en mercados organizados, incluyendo los representativos de la cesión a terceros de capitales propios y los valores representativos de la participación en fondos propios de cualquier tipo de entidad, con su valor de negociación medio correspondiente al cuarto trimestre de cada año.

Para publicar la mencionada información se ha contado con la colaboración técnica de la Comisión Nacional del Mercado de Valores, que, como Agencia Nacional de Codificación, ha procedido a la consolidación de los datos provenientes de cada una de las cuatro Bolsas de Valores, incorporándose la tipología del valor al correspondiente código ISIN, su denominación y la del emisor, con el fin de facilitar la identificación y valoración de sus valores por parte de los contribuyentes y de las entidades depositarias.

Se incluyen en dicha información, como en ejercicios anteriores, las cotizaciones medias de los valores negociados en el mercado de Deuda Pública en Anotaciones, cuya relación se ha elaborado con los datos suministrados por el Banco de España, en su condición de organismo rector del sistema, y, como en los demás supuestos, con la colaboración técnica de la Comisión Nacional del Mercado de Valores.

Además, se añaden las cotizaciones medias del último trimestre de los valores de renta fija privada negociados en el mercado de la Asociación de Intermediarios de Activos Financieros (AIAF), con lo que se completan los datos de la totalidad de los valores negociados en los mercados organizados, que actualmente funcionan en nuestro país.

En su virtud, dispongo:

Artículo único. Aprobación de las relaciones de valores negociados.

Se aprueba la relación de valores negociados en Bolsa con su cotización media correspondiente al cuarto trimestre de 2010; la relación de valores negociados y su cotización, en el último trimestre del año, en el mercado de Deuda Pública anotada, así como la relación y los valores medios de cotización del mercado de la Asociación de Intermediarios de Activos Financieros (AIAF) del último trimestre de 2010, anexas a esta Orden, a efectos de la cumplimentación de la declaración informativa anual acerca de valores, seguros y rentas, aprobada por la Orden EHA/3481/2008, de 1 de diciembre.

Disposición final única. *Entrada en vigor.*

La presente orden entrará en vigor el día siguiente al de su publicación en el «Boletín Oficial del Estado».

Madrid, 24 de febrero de 2011.–La Vicepresidenta Segunda del Gobierno y Ministra de Economía y Hacienda, Elena Salgado Méndez.

ANEXO

Relación de valores o participaciones con su valor de negociación medio o de liquidación media relativa al cuarto trimestre de 2010, a los efectos previstos en el artículo 39 del Reglamento General de las actuaciones y los procedimientos de gestión e inspección tributaria y de desarrollo de las normas comunes de los procedimientos de aplicación de los tributos, aprobado por el Real Decreto 1065/2007, de 27 de julio

Criterio de ordenación:

1º Tipo de renta: Fija y variable, 2º por categoría de valor de acuerdo a las contempladas por la ANCV(*),
3º Por nombre del emisor y 4º Por ISIN.

RENTA FIJA

DEUDA EMITIDA POR EL ESTADO, C.C.A.A. Y ORGANISMOS AUTÓNOMOS

DEPENDIENTES DE UNO U OTRAS. (Sin valor nominal unitario)

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011595	ESTADO/8,70 OBE 20120228	28/02/2012	8,700	107,818
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011660	ESTADO/6,15 OBE SEGR 20130131	31/01/2013	6,150	106,867
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011702	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20130131	31/01/2013	C	92,906
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011843	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20120131	31/01/2012	C	96,800
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011850	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20130131	31/01/2013	C	94,682
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011868	ESTADO/6,00 OBE SEGR 20290131	31/01/2029	6,000	108,266
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011876	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20290131	31/01/2029	C	36,087
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011884	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20140131	31/01/2014	C	87,250
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011892	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20150131	31/01/2015	C	84,870
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011900	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20160131	31/01/2016	C	83,380
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011918	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170131	31/01/2017	C	75,733
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011926	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20180131	31/01/2018	C	75,875
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011942	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20200131	31/01/2020	C	65,143
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011959	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20210131	31/01/2021	C	61,049
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012023	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20270131	31/01/2027	C	38,308
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012049	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20290131	31/01/2029	C	34,704
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012098	ESTADO/4,75 OBE SEGR 20140730	30/07/2014	4,750	105,426
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120D1	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20370131	31/01/2037	C	25,599
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120G4	ESTADO/3,15 OBE SEGR 20160131	31/01/2016	3,150	96,815
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120I0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20160131	31/01/2016	C	79,985
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120J8	ESTADO/3,80 OBE SEGR 20170131	31/01/2017	3,800	98,044
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120L4	ESTADO/3,90 BOEST SEGR 20121031	31/10/2012	3,900	101,950
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120M2	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20170131	31/01/2017	C	74,671
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120N0	ESTADO/4,90 OBE SEGR 20400730	30/07/2040	4,900	94,033
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120O8	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20400730	30/07/2040	C	17,226
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120P5	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20330730	30/07/2033	C	31,728
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120Q3	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20340730	30/07/2034	C	26,137
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120T7	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20370730	30/07/2037	C	25,359
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120U5	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20380730	30/07/2038	C	24,484
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120V3	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20390730	30/07/2039	C	23,902
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120W1	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20400730	30/07/2040	C	19,626
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120X9	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20121031	31/10/2012	C	94,659
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120Z4	ESTADO/4,10 BOEST SEGR 20110430	30/04/2011	4,100	100,995
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121A5	ESTADO/4,10 OBE SEGR 20180730	30/07/2018	4,100	98,417
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121F4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20180730	30/07/2018	C	75,015
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121G2	ESTADO/4,80 OBESEGR 20240131	31/01/2024	4,800	99,034
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121H0	ESTADO/4,25 BOEST SEGR 20140131	31/01/2014	4,250	102,971
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121I8	ESTADO/2,75 BOEST SEGR 20120430	30/04/2012	2,750	100,281
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121J6	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20140131	31/01/2014	C	90,647
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121L2	ESTADO/4,60 OBESEGR 20190730	30/07/2019	4,600	101,633
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121O6	ESTADO/4,30 OBESEGR 20191031	31/10/2019	4,300	98,806
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121P3	ESTADO/3,30 BOEST SEGR 20141031	31/10/2014	3,300	99,712
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121Q1	ESTADO/VAR BOEST SEGR 20121029	29/10/2012	V	96,714
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121R9	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20190730	30/07/2019	C	68,637
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121S7	ESTADO/4,70 OBESEGR 20410730	30/07/2041	4,700	89,593
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121T5	ESTADO/2,30 BOEST SEGR 20130430	30/04/2013	2,300	98,799
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121V1	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20191031	31/10/2019	C	64,391
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122D7	ESTADO/4,00 OBESEGR 20200430	30/04/2020	4,000	95,866
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122E5	ESTADO/4,65 OBESEGR 20250730	30/07/2025	4,650	95,097
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122F2	ESTADO/3,00 BOEST SEGR 20150430	30/04/2015	3,000	97,646
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122G0	ESTADO/VAR BOEST SEGR 20150317	17/03/2015	V	93,225
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122R7	ESTADO/2,50 BOESTSEGR 20131031	31/10/2013	2,500	98,195
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122T3	ESTADO/4,85 OBESEGR 20201031	31/10/2020	4,850	101,251
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122U1	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20250730	30/07/2025	C	42,149
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122V9	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20410730	30/07/2041	C	15,863
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122X5	ESTADO/3,25 BOESTSEGR 20160430	30/04/2016	3,250	94,850
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012304	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20140730	30/07/2014	C	87,772

(*) ANCV: Agencia Nacional de Codificación de Valores

(**) V: Cupón Variable, C: Cupón Cero

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012320	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20110730	30/07/2011	C	98,500
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012353	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20140730	30/07/2014	C	90,322
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012387	ESTADO/5,40 OBE SEGR 20110730	30/07/2011	5,400	102,316
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012411	ESTADO/5,75 OBE 20320730	30/07/2032	5,750	105,310
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012429	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20110730	30/07/2011	C	98,829
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012452	ESTADO/5,35 OBE SEGR 20111031	31/10/2011	5,350	102,756
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012510	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20111031	31/10/2011	C	98,344
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012593	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20320730	30/07/2032	C	32,671
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012601	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20150730	30/07/2015	C	85,827
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012627	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170730	30/07/2017	C	72,123
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012635	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20180730	30/07/2018	C	67,437
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012643	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20190730	30/07/2019	C	66,962
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012650	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20200730	30/07/2020	C	58,600
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012668	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20210730	30/07/2021	C	60,173
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012767	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20310730	30/07/2031	C	32,087
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012775	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20320730	30/07/2032	C	30,937
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012783	ESTADO/5,50 OBE SEGR 20170730	30/07/2017	5,500	107,286
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012791	ESTADO/5,00 OBE SEGR 20120730	30/07/2012	5,000	103,730
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012809	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20120730	30/07/2012	C	95,512
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012866	ESTADO/4,20 OBE SEGR 20130730	30/07/2013	4,200	102,786
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012874	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20130730	30/07/2013	C	93,897
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012916	ESTADO/4,40 OBE SEGR 20150131	31/01/2015	4,400	103,603
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012932	ESTADO/4,20 OBE SEGR 20370131	31/01/2037	4,200	83,345
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012957	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20310131	31/01/2031	C	29,325
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012981	ESTADO/CUPCER BOEST 20340131	31/01/2034	C	24,630
FONDO DE REESTRUCTURACION ORDENADA BANCARIA	ES0302761004	FROB/3,00 BO 20141119 GTIA	19/11/2014	3,000	97,960
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES000000950A7	GENCAT/VAR BO 20110428	28/04/2011	V	99,801
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES000000950D1	GENCAT/VAR BO 20130211	11/02/2013	V	94,896
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES000000950E9	GENCAT/4,95 OB 20200211	11/02/2020	4,950	95,593
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES000000950F6	GENCAT/5,75 BO 20150625	25/06/2015	5,750	107,960
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES000000950I0	GENCAT/3,936 BO 20131031	31/10/2013	3,936	99,412
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000095838	GENCAT/4,35 OB 20140716	16/07/2014	4,350	98,257
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000095861	GENCAT/3,875 OB 20150915	15/09/2015	3,875	95,645
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000095887	GENCAT/3,25 OB 20111130	30/11/2011	3,250	99,606
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000095895	GENCAT/4,30 OB 20161115	15/11/2016	4,300	95,649
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000095903	GENCAT/4,12 BO 20130423	23/04/2013	4,125	98,518
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000095911	GENCAT/3,85 BO 20110930	30/09/2011	3,850	100,352
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000095929	GENCAT/4,75 OB 20180604	04/06/2018	4,750	92,544
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES05000095C45	GENCAT/PAG 20110621	21/06/2011		98,009
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES05000095C78	GENCAT/2,125 PAG 20110518	18/05/2011		98,968
GOBIERNO VASCO	ES00000106429	GOB.VASCO/5,55 OB 20141126	26/11/2014	5,550	107,494
GOBIERNO VASCO	ES00000106437	GOB.VASCO/4,15 OB 20191028	28/10/2019	4,150	91,483
GOBIERNO VASCO	ES00000106445	GOB.VASCO/4,60 BO 20250107	07/01/2025	4,600	87,623
GOBIERNO VASCO	ES00000106478	GOB.VASCO/4,125 BO 20150630	30/06/2015	4,125	98,051
GOBIERNO VASCO	ES00000106486	GOB.VASCO/4,75 OB 20170705	05/07/2017	4,750	95,760
GOBIERNO VASCO	ES00000106494	GOB.VASCO/3,99 OB 20160128	28/01/2016	3,990	98,469

DEPENDIENTES DE UNO U OTRAS. (Con valor nominal unitario)

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES000000950J8	GENCAT/4,75 BO 20111121	21/11/2011	4,750	100,223
GENERALIDAD VALENCIANA	ES00000105678	GENVAL/4,75 BO 20111222	22/12/2011	4,750	1.000,00

LETRAS DEL TESORO

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01101218	ESTADO/LT 20110121	21/01/2011	C	99,798
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01102182	ESTADO/LT 20110218	18/02/2011	C	99,636
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01103180	ESTADO/LT 20110318	18/03/2011	C	99,552
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01104212	ESTADO/LT 20110421	21/04/2011	C	99,254
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01105201	ESTADO/LT 20110520	20/05/2011	C	99,062
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01106175	ESTADO/LT 20110617	17/06/2011	C	98,728
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01107223	ESTADO/LT 20110722	22/07/2011	C	98,579
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01108197	ESTADO/LT 20110819	19/08/2011	C	98,418
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01109237	ESTADO/LT 20110923	23/09/2011	C	98,255
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01110219	ESTADO/LT 20111021	21/10/2011	C	97,949
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01111183	ESTADO/LT 20111118	18/11/2011	C	97,317
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01112165	ESTADO/LT 20111216	16/12/2011	C	97,039
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01202172	ESTADO/LT 20120217	17/02/2012	C	97,243
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01204202	ESTADO/LT 20120420	20/04/2012	C	96,302
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01206223	ESTADO/LT 20120622	22/06/2012	C	94,704

OBLIGACIONES

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845179	ABE/4,75 OB 20140211	11/02/2014	4,750	103.400,86
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845203	ABE/4,375 OB 20200330	30/03/2020	4,375	89.356,78
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845211	ABE/5,125 OB 20170612	12/06/2017	5,125	49.911,24
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845237	ABE/4,625 OB 20161014	14/10/2016	4,625	49.353,20
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR LEONESA, S.A.	ES0211843083	AUCALSA/4,00 OB 20140608	08/06/2014	4,000	494,65
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR LEONESA, S.A.	ES0211843091	AUCALSA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3,700	483,27
AUTOPISTA VASCO-ARAGONESA, C.E.S.A.	ES0211837077	AVASA/3,55 OB 20150615	15/06/2015	3,550	965,24
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839107	AUDASA/4,19 OB 20110531	31/05/2011	4,190	499,36
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839115	AUDASA/4,33 OB 20120516	16/05/2012	4,330	607,71
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839123	AUDASA/3,83 OB 20130626	26/06/2013	3,830	498,43
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839131	AUDASA/4,00 OB 20140608	08/06/2014	4,000	493,94
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839149	AUDASA/3,32 OB 20151212	12/12/2015	3,320	479,96
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839156	AUDASA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3,700	481,44
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839164	AUDASA/4,85 OB 20180327 GTIA	27/03/2018	4,850	504,12
AUTOVIA DE LOS VIÑEDOS, S.A. CONCESIONARIA	ES0211966009	AUVISA/4,79 OB 20271215	15/12/2027	4,790	78.655,61
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211099	BBVA/VAR OB SUBD 20191020	20/10/2019	V	95.444,53
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211107	BBVA/VAR OB SUBD 20220216	16/02/2022	V	45.500,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211123	BBVA/CUPCER OBESTR 20160411	11/04/2016	C	63.390,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211172	BBVA/CUPCER OBESTR 20171016 14	16/10/2017	C	25.793,93
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211180	BBVA/CUPCER OBESTR 20171211 25	11/12/2017	C	26.257,50
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	ES0214825012	CA.ALBACETE/VAR OB SUBD PERP	V	V	609,32
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	ES0214825020	CA.ALBACETE/VAR OB SUBD PERP	V	V	607,94
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	ES0214842017	CA.CUENCA-C.R./VAR OB SUBD PERP	V	V	302,04
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	ES0214842025	CA.CUENCA-C.R./VAR OB PREF PERP	V	V	302,50
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	ES0215424096	CCM/VAR OB SUBD 20110604	04/06/2011	V	599,99
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	ES0215424120	CCM/VAR OB SUBD 20141220	20/12/2014	V	161.973,30
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	ES0215424138	CCM/VAR OB SUBD 20171214	14/12/2017	V	80.218,08
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	ES0215424161	CCM/VAR OB SUBD PERP	V	V	66.246,44
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	ES0215424179	CCM/VAR OB 20140528	28/05/2014	V	84.396,65
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860036	SAB/VAR OB SUBD 20160525	25/05/2016	V	83.900,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860051	SAB/6,25 OBSUBD 20200426	26/04/2020	6,250	47.509,07
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980016	BVA/VAR OB SUBD 20110329	29/03/2011	V	6.007,33
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980024	BVA/VAR OB SUBD 20141215	15/12/2014	V	3.003,82
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980032	BVA/VAR OB SUBD 20150615	15/06/2015	V	40.000,00
BANCO EUROPEO DE RECONSTRUCCION Y DESARROLLO	ES0213461009	BERD/8,46 OB 20251201	01/12/2025	8,460	9.040,76
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051008	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20130630	30/06/2013	V	595,38
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051016	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20131030	30/10/2013	V	599,24
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051057	BCO.GALLEGO/VAR OBSUBD 20191229	29/12/2019	V	99,96
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580006	GUI/4,75 OB SUBD 20110415	15/04/2011	4,750	500,02
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580014	GUI/4,50 OB SUBD 20121015	15/10/2012	4,500	499,99
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580022	GUI/4,20 OB SUBD 20141015	15/10/2014	4,200	498,30
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580030	GUI/VAR OB SUBD 20160321	21/03/2016	V	83.827,24
BANCO PASTOR, S.A.	ES0213770011	PAS/VAR OB SUBD PERP	V	V	49.836,79
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790001	POP/VAR OBSUBD 20191222	22/12/2019	V	47.189,76
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0213540018	BBE/VAR OB SUBD 20160323	23/03/2016	V	94.500,00
BANKINTER, S.A.	ES0213679121	BKT/VAR OB 20150316	16/03/2015	V	462,77
BANKINTER, S.A.	ES0213679139	BKT/VAR OB SUBD 20160321	21/03/2016	V	85.142,79
BANKINTER, S.A.	ES0213679170	BKT/VAR OB SUBD 20170316	16/03/2017	V	84.105,56
BANKINTER, S.A.	ES0213679188	BKT/VAR OBSUBD 20181010	10/10/2018	V	49.498,00
BANKINTER, S.A.	ES0213679196	BKT/6,375 OBSUBD 20190911	11/09/2019	6,375	51.143,88
BANKINTER, S.A.	ES0213679212	BKT/4,27 OB 20160722	22/07/2016	4,270	100.000,00
BARCLAYS BANK, S.A.	ES0214050041	ZRG/VAR OB SUBD 20110101	01/01/2011	V	600,00
BBK BANK CAJASUR, S.A.U.	ES0264730039	CAJASUR/VAR OB SUBD 20131201	01/12/2013	V	500,01
BBK BANK CAJASUR, S.A.U.	ES0264730054	CAJASUR/VAR OB SUBD 20150311	11/03/2015	V	93.647,66
BILBAO BIZKAIA KUTXA	ES0214100010	BBK/VAR OB SUBD 20160301	01/03/2016	V	91.426,77
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0257080004	BPEF/VAR OB SUBD 20140630	30/06/2014	V	900,00
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0257080012	BPEF/VAR OB SUBD 20151223	23/12/2015	V	89.613,10
CABILDO INSULAR DE TENERIFE	ES0201330000	CBDO.TEN/VAR OB 20111217	17/12/2011	V	989,20
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0214843015	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD PERP	V	V	598,29
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0214843023	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD PERP	V	V	597,10
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0214843080	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20121001	01/10/2012	V	576,84
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0214843098	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20131103	03/11/2013	V	582,79
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0214843106	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20140401	01/04/2014	V	588,16
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0214843114	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20150104	04/01/2015	V	573,60
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0214843122	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20150704	04/07/2015	V	486,75
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0214843130	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20160912	12/09/2016	V	44.199,55
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0214843148	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD PERP	V	V	30.510,27
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0214958011	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20180108	08/01/2018	V	30,00
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0214958029	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20180804	04/08/2018	V	600,02
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0214958037	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20190126	26/01/2019	V	600,00
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0214958045	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20201209	09/12/2020	V	80.120,82
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0214958052	CAIXANOVA/VAR OB SUBD PERP	V	V	23.500,00
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0214958060	CAIXANOVA/VAR OB 20160531	31/05/2016	V	40.902,50
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0214958136	CAIXANOVA/VAR OBSUBD 20191216	16/12/2019	V	100,00
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0214840201	CA.CATALUNYA/VAR OB SUBD 20150519	19/05/2015	V	1.499,95
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0214840235	CA.CATALUNYA/VAR OB SUBD 20200220	20/02/2020	V	1.500,02
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0214840250	CA.CATALUNYA/VAR OB 20120706	06/07/2012	V	95.400,01
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0214840276	CA.CATALUNYA/VAR OB 20210321	21/03/2021	V	81.841,27
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0214840342	CA.CATALUNYA/VAR OBSUBD 20181218	18/12/2018	V	500,00

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0214850051	CA.MANRESA/VAR OB SUBD 20160505	05/05/2016	V	95.883,83
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0215346000	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20150527	27/05/2015	V	594,91
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0215346018	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20151027	27/10/2015	V	595,81
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0215346026	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20160427	27/04/2016	V	594,00
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0215346034	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20161027	27/10/2016	V	595,20
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0215346042	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20170127	27/01/2017	V	496,50
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0215346059	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20171127	27/11/2017	V	495,55
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0215346067	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20180727	27/07/2018	V	495,00
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966006	CA.PENEDES/VAR OB SUBD PERP	V	V	600,84
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966014	CA.PENEDES/VAR OB SUBD PERP	V	V	999,96
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966022	CA.PENEDES/VAR OB SUBD 20161222	22/12/2016	V	999,78
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966030	CA.PENEDES/VAR OBSUBD 20190629	29/06/2019	V	999,52
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0214846042	CA.LAIETANA/VAR OB SUBD 20111010	10/10/2021	V	999,87
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0214846059	CA.LAIETANA/VAR OB SUBD 20350315	15/03/2035	V	999,81
CAIXA D'ESTALVIS UNIO DE CAIXES DE MANLLEU, SABAI	ES0214841027	CA.MANLLEU/VAR OB SUBD 20130601	01/06/2013	V	499,93
CAIXA D'ESTALVIS UNIO DE CAIXES DE MANLLEU, SABAI	ES0214973051	CA.SABADELL/VAR OB SUBD 20200128	28/01/2020	V	77.732,99
CAIXA D'ESTALVIS UNIO DE CAIXES DE MANLLEU, SABAI	ES0214973069	CA.SABADELL/VAR OB SUBD 20170215	15/02/2017	V	47.427,11
CAIXA D'ESTALVIS UNIO DE CAIXES DE MANLLEU, SABAI	ES0214973077	CA.SABADELL/VAR OBSUBD 20240610	10/06/2024	V	920,58
CAIXA D'ESTALVIS UNIO DE CAIXES DE MANLLEU, SABAI	ES0214974018	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD PERP	V	V	601,01
CAIXA D'ESTALVIS UNIO DE CAIXES DE MANLLEU, SABAI	ES0214974034	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20131230	30/12/2013	V	1.001,48
CAIXA D'ESTALVIS UNIO DE CAIXES DE MANLLEU, SABAI	ES0214974042	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20190730	30/07/2019	V	1.000,75
CAIXA D'ESTALVIS UNIO DE CAIXES DE MANLLEU, SABAI	ES0214974059	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20210809	09/08/2021	V	86.580,12
CAIXA D'ESTALVIS UNIO DE CAIXES DE MANLLEU, SABAI	ES0214974067	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20210809	09/08/2021	V	76.142,10
CAIXA D'ESTALVIS UNIO DE CAIXES DE MANLLEU, SABAI	ES0214974117	CA.TERRASSA/VAR OBSUBD 20190929	29/09/2019	V	999,41
CAIXA D'ESTALVIS UNIO DE CAIXES DE MANLLEU, SABAI	ES0314973027	CA.SABADELL/VAR OBSUBD PERP	V	V	599,30
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0214826010	CA.JASTUR/VAR OBSUBD 20190616	16/06/2019	V	100,00
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845002	CAI/VAR OB SUBD 20131222	22/12/2013	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845010	CAI/VAR OB SUBD 20140629	29/06/2014	V	94.371,61
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845028	CAI/VAR OB SUBD 20160525	25/05/2016	V	45.502,32
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845036	CAI/VAR OB SUBD 20190228	28/02/2019	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600035	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP	V	V	302,82
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600043	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP	V	V	304,02
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600050	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP	V	V	300,54
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600084	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP	V	V	300,53
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600092	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP	V	V	300,53
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600175	CA.MURCIA/VAR OB SUBD 20141215	15/12/2014	V	300,01
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600191	CA.MURCIA/VAR OB SUBD 20230630	30/06/2023	V	500,05
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0214975007	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20121010	10/10/2012	V	1.000,01
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0214975015	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20140330	30/03/2014	V	1.000,02
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0214975023	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20151213	13/12/2015	V	40.370,59
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0214977037	BANCAJA/VAR OB SUBD PERP	V	V	601,01
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0214977052	BANCAJA/VAR OB SUBD 20220704	04/07/2022	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0214977060	BANCAJA/3,94 OB 20150918	18/09/2015	3,940	1.000,24
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0214977078	BANCAJA/VAR OB SUBD 20181129	29/11/2018	V	65.126,15
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0214977086	BANCAJA/VAR OB 20120606	06/06/2012	V	94.977,01
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0214977102	BANCAJA/VAR OB SUBD PERP	V	V	61.189,66
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0214977128	BANCAJA/4,25 OB 20130526	26/05/2013	4,250	97.628,61
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0214977136	BANCAJA/VAR OB 20130923	23/09/2013	V	91.376,87
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0214977151	BANCAJA/VAR OB 20140423	23/04/2014	V	43.334,93
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0214977169	BANCAJA/VAR OBSUBD 20190706	06/07/2019	V	996,90
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0215307028	CA.SAGUNTO/VAR OB SUBD PERP	V	V	601,01
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0215307036	CA.SAGUNTO/VAR OB SUBD 20120630	30/06/2012	V	601,01
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0214400014	CAM/VAR OB SUBD PERP	V	V	605,25
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0214400048	CAM/VAR OB SUBD PERP	V	V	600,01
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0214400055	CAM/VAR OB 20150815	15/08/2015	V	1.000,02
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0215395015	CAM/VAR OB SUBD PERP	V	V	605,70
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0214910012	CA.AVILA/VAR OBSUBD 20181029	29/10/2018	V	49.007,05
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMAD	ES0214987028	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20171115	15/11/2017	V	500,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMAD	ES0214987044	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20191021	21/10/2019	V	500,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMAD	ES0214987069	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20200401	01/04/2020	V	500,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMAD	ES0214987077	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20210425	25/04/2021	V	7.523,85
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEAR	ES0214926018	SA.NOSTRA/VAR OB SUBD 20141230	30/12/2014	V	93.116,85
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEAR	ES0214926026	SA.NOSTRA/VAR OB SUBD 20150318	18/03/2015	V	1.000,05
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEAR	ES0214926034	SA.NOSTRA/VAR OBSUBD 20190630	30/06/2019	V	1.000,27
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950059	CA.MADRID/6,25 OB SUBD 20120410	10/04/2012	6,250	99.664,46
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950109	CA.MADRID/4,00 OB 20110302	02/03/2011	4,000	1.001,95
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950117	CA.MADRID/3,76 OB 20110331	31/03/2011	3,760	1.001,67
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950125	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20140715	15/07/2014	V	83.328,57
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950133	CA.MADRID/VAR OB 20120601	01/06/2012	V	95.815,22
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950141	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20180301	01/03/2018	V	73.918,88
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950158	CA.MADRID/VAR OB 20120209	09/02/2012	V	96.585,24
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950166	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20161017	17/10/2016	V	40.810,87
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950216	CA.MADRID/5,116 OBSUBD 20150715	15/07/2015	5,116	98.005,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950224	CA.MADRID/VAR OBSUBD 20200607	07/06/2020	V	999,98
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0214965008	CAN/VAR OB SUBD 20160616	16/06/2016	V	81.053,35
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0214965024	CAN/VAR OBSUBD 20190630	30/06/2019	V	1.000,06
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0214959068	CA.SEGOVIA/VAR OB SUBD 20160728	28/07/2016	V	48.132,50
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0214959076	CA.SEGOVIA/VAR OB SUBD 20170620	20/06/2017	V	41.671,23
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES0214954010	IBERCAJA/VAR OB PREF PERP	V	V	601,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES0214954028	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP	V	V	601,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES0214954036	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP	V	V	601,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES0214954044	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP	V	V	601,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES0214954135	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20180420	20/04/2018	V	395,03
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES0214954143	IBERCAJA/VAR OB 20120720	20/07/2012	V	97.275,00

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES0214954150	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20190425	25/04/2019	V	377,03
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0213249008	CA.GIRONA/VAR OB SUBD 20160921	21/09/2016	V	82.792,74
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970032	LACAIXA/VAR OB SUBD 20111010	10/10/2011	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970040	LACAIXA/VAR OB SUBD 20120412	12/04/2012	V	10,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970057	LACAIXA/VAR OB SUBD 20120722	22/07/2012	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970065	LACAIXA/VAR OBSUBD 20190228	28/02/2019	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970073	LACAIXA/VAR OBSUBD 20200330	30/03/2020	V	1.000,03
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA,	ES0214854012	CAJADUERO/VAR OBSUBD 20150630	30/06/2015	V	42.784,14
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA,	ES0214854020	CAJADUERO/VAR OBSUBD 20181219	19/12/2018	V	50.566,07
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA,	ES0214854038	CAJADUERO/VAR OBSUBD 20190928	28/09/2019	V	1.000,45
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA,	ES0215474166	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20181229	29/12/2018	V	994,63
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA,	ES0215474190	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20151207	07/12/2015	V	81.128,55
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA,	ES0215474208	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20160131	31/01/2011	V	947,37
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA,	ES0215474224	CA.ESPAÑA/VAR OB 20140326	26/03/2014	V	87.005,00
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA,	ES0215474232	CA.ESPAÑA/7,50 OBSUBD 20180828	28/08/2018	7,500	1.034,95
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA,	ES0215474240	CA.ESPAÑA/VAR OBSUBD 20200223	23/02/2020	V	997,27
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA,	ES0215474257	CA.ESPAÑA/VAR OBSUBD 20200629	29/06/2020	V	968,53
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981013	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD PERP	V	V	607,25
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981039	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20321015	15/10/2032	V	299,78
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981054	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20200628	28/06/2020	V	299,93
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES0214982110	CA.GRANADA/VAR OB SUBD 20150630	30/06/2015	V	93.757,63
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES0214982136	CA.GRANADA/VAR OBSUBD 20190316	16/03/2019	V	999,91
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983019	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP	V	V	301,79
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983035	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP	V	V	301,51
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983084	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20120801	01/08/2012	V	599,99
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983092	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20131101	01/11/2013	V	499,98
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983118	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20150412	12/04/2015	V	95.331,02
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983126	LA.CAJA/VAR OB 20111005	05/10/2011	V	97.043,71
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983134	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP	V	V	31.412,24
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983142	LA.CAJA/VAR OBSUBD 20190902	02/09/2019	V	49.779,31
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP.	ES0215316029	RURALCAJA/VAR OB SUBD 20151122	22/11/2015	V	82.426,38
CAJAMAR CAJA RURAL, S. COOP. DE CREDITO	ES0214601017	CAJAMAR/VAR OB SUBD 20150316	16/03/2015	V	81.215,03
CORPORACION DE RESERVAS ESTRATEGICA DE PRODU	ES0224261000	CORES/4,00 OB 20130715	15/07/2013	4,000	102.301,25
CORPORACION DE RESERVAS ESTRATEGICA DE PRODU	ES0224261018	CORES/4,50 OB 20180423	23/04/2018	4,500	97.290,19
DEUTSCHE BANK, A.G.	DE0003936933	OB. DEUTSCHE BANK	10/11/2014	4,155	1.008,42
DEUTSCHE BANK, S.A.E.	ES0213320015	DT.BK.SAE/VAR OB SUBD 20131230	30/12/2013	V	95,65
DEUTSCHE BANK, S.A.E.	ES0213320023	DT.BK.SAE/VAR OB SUBD 20140331	31/03/2014	V	92,32
ENAGAS, S.A.	ES0230960009	ENG/4,375 OB 20150706	06/07/2015	4,375	53.392,92
EROSKI, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429004	EROSKI/VAR OB SUBD PERP	V	V	25,06
EROSKI, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429038	EROSKI/VAR OB SUBD PERP	V	V	25,00
EUROP. PARA LA FINANC. MATERIAL FERROVIARIO	ES0233813163	EUROFIMA/11,00 OB 20141118	18/11/2014	11,000	8.042,89
FAGOR ELECTRODOMESTICOS, SOCIEDAD COOPERATI	ES0235972009	FAGOR/VAR OB SUBD 1ª PERP	V	V	20,41
FAGOR ELECTRODOMESTICOS, SOCIEDAD COOPERATI	ES0235972017	FAGOR/VAR OB SUBD 2ª PERP	V	V	12,99
IBERDROLA, S.A.	ES0244520138	HIDROLA/6,75 OB 20121215	15/12/2012	6,750	6,11
LANDESBANK HESSEN-THÜRNINGEN GIROZENTRALE	ES0257763005	HELABA/5,60 OB SUBD 20180529	29/05/2018	5,600	623,25
M.P. Y C.A. SAN FERNANDO DE GUADALAJARA, HUELVA,	ES0214979066	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20111106	06/11/2011	V	1.000,00
M.P. Y C.A. SAN FERNANDO DE GUADALAJARA, HUELVA,	ES0214979082	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20121001	01/10/2012	V	999,99
M.P. Y C.A. SAN FERNANDO DE GUADALAJARA, HUELVA,	ES0214979116	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20131001	01/10/2013	V	1.000,00
M.P. Y C.A. SAN FERNANDO DE GUADALAJARA, HUELVA,	ES0214979132	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20141025	25/10/2014	V	1.000,01
M.P. Y C.A. SAN FERNANDO DE GUADALAJARA, HUELVA,	ES0214979157	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20151128	28/11/2015	V	805,26
M.P. Y C.A. SAN FERNANDO DE GUADALAJARA, HUELVA,	ES0214979173	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20171227	27/12/2017	V	999,95
M.P. Y C.A. SAN FERNANDO DE GUADALAJARA, HUELVA,	ES0214979181	CA.GUADALAJ/VAR OBSUBD 20191230	30/12/2019	V	999,81
M.P. Y C.A. SAN FERNANDO DE GUADALAJARA, HUELVA,	ES0217156092	EL.MONTE/VAR OB SUBD PERP	V	V	73.512,89
M.P. Y C.A. SAN FERNANDO DE GUADALAJARA, HUELVA,	ES0264870017	EL.MONTE/VAR OB SUBD PERP	V	V	1.509,16
MAPFRE, S.A.	ES0224244055	MAP/6,02 OB 20110712	12/07/2011	6,020	101.307,70
MAPFRE, S.A.	ES0224244063	MAP/VAR OB SUBD 20370724	24/07/2037	V	43.548,27
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE B	ES0214920029	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD PERP	V	V	610,44
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE B	ES0214920045	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD PERP	V	V	601,01
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE B	ES0214920052	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD PERP	V	V	601,02
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE B	ES0214920060	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD 20211018	18/10/2021	V	599,99
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE B	ES0214920078	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD 20230610	10/06/2023	V	600,00
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE B	ES0214920086	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD 20250608	08/06/2025	V	600,00
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE B	ES0214920094	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD 20220615	15/06/2022	V	600,48
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0213495007	SAN.CONS.FIN/VAR OB SUBD 20160928	28/09/2016	V	46.771,66
TELEFONICA, S.A.	ES0278430964	TEF/VAR OB 20150302	02/03/2015	V	98.480,85
VIDACAIXA, S.A. DE SEGUROS Y REASEGUROS	ES0283691006	VIDACAIXA/VAR OB SUBD PERP	V	V	1.000,00
VIDACAIXA, S.A. DE SEGUROS Y REASEGUROS	ES0283691014	VIDACAIXA/VAR OB SUBD PERP	V	V	1.000,00

BONOS

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
AYT BONOS TESORERIA II, F.T.A.	ES0312271002	AYT.BO.TESOR.II/VAR BTA 20130224 A	24/02/2013	V	31.339,42
AYT BONOS TESORERIA II, F.T.A.	ES0312271010	AYT.BO.TESOR.II/VAR BTA 20130224 B	24/02/2013	V	85.790,14
AYT BONOS TESORERIA II, F.T.A.	ES0312271028	AYT.BO.TESOR.II/VAR BTA 20130224 C	24/02/2013	V	90.333,64
AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, F.T.A.	ES0312272000	AYT.CAMUR.H.II/VAR BTA 20390407 A	07/04/2039	V	46.468,27
AYT CEAMI EMTN I, F.T.A.	ES0312193008	AYT.CEAMI.I/VAR BTA 20111103 GTIA	03/11/2011	V	26.639,73
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298005	AYT.CCG/VAR BTA 20121214 I GTIA	14/12/2012	V	93.669,37

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298013	AYT.CCG/3,50 BTA 20160314 II GTIA	14/03/2016	3,500	91.603,12
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298021	AYT.CCG/3,75 BTA 20221214 III GTIA	14/12/2022	3,750	75.699,31
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298054	AYT.CCG/4,00 BTA 20210324 VI GTIA	24/03/2021	4,000	82.567,05
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298070	AYT.CCG/4,25 BTA 20180614 VIII GTIA	14/06/2018	4,250	89.074,50
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298088	AYT.CCG/3,75 BTA 20131025 IX GTIA	25/10/2013	3,750	97.717,67
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298096	AYT.CCG/4,25 BTA 20231025 X GTIA	25/10/2023	4,250	76.638,16
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298104	AYT.CCG/4,00 BTA 20161220 XI GTIA	20/12/2016	4,000	90.826,60
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298112	AYT.CCG/4,00 BTA 20170321 XII GTIA	21/03/2017	4,000	87.502,50
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298120	AYT.CCG/4,75 BTA 20270525 XIII GTIA	25/05/2027	4,750	78.638,90
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298153	AYT.CCG/VAR BTA 20171023 XVI GTIA	23/10/2017	V	79.648,82
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298195	AYT.CCG/VAR BTA 20151124 XX GTIA	24/11/2015	V	90.475,53
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298211	AYT.CCG/3,50 BTA 20120217 XXII GTIA	17/02/2012	3,500	99.095,05
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298229	AYT.CCG/4,75 BTA 20160615 XXIII	15/06/2016	4,750	95.712,89
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298237	AYT.CCG/4,25 BTA 20140729 XXIV GTIA	29/07/2014	4,250	97.141,95
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298245	AYT.CCG/4,50 BTA 20191202 XXV GTIA	02/12/2019	4,500	93.801,37
AYT CEDULAS CAJAS III, F.T.A.	ES0361002001	AYT.CED.CA.III/5,25 BTA 20120628	28/06/2012	5,250	101.780,46
AYT CEDULAS CAJAS IV, F.T.A.	ES0312368006	AYT.CED.CA.IV/4,00 BTA 20130313	13/03/2013	4,000	97.361,37
AYT CEDULAS CAJAS IX, F.T.A.	ES0312358007	AYT.CED.CA.IX/3,75 BTA 20150331 A	31/03/2015	3,750	94.206,78
AYT CEDULAS CAJAS IX, F.T.A.	ES0312358015	AYT.CED.CA.IX/4,00 BTA 20200331 B	31/03/2020	4,000	84.864,04
AYT CEDULAS CAJAS V, F.T.A.	ES0370148019	AYT.CED.CA.V/4,75 BTA 20181204 B	04/12/2018	4,750	92.594,88
AYT CEDULAS CAJAS VI, F.T.A.	ES0312360003	AYT.CED.CA.VI/4,00 BTA 20140407 A	07/04/2014	4,000	97.639,56
AYT CEDULAS CAJAS VII, F.T.A.	ES0312361001	AYT.CED.CA.VII/4,00 BTA 20110623	23/06/2011	4,000	100.636,70
AYT CEDULAS CAJAS VIII, F.T.A.	ES0312362009	AYT.CED.CA.VIII/4,00 BTA 20141118 A	18/11/2014	4,000	96.377,49
AYT CEDULAS CAJAS VIII, F.T.A.	ES0312362017	AYT.CED.CA.VIII/4,25 BTA 20191118 B	18/11/2019	4,250	89.628,79
AYT CEDULAS CAJAS X, F.T.A.	ES0312342001	AYT.CED.CA.X/VAR BTA 20150630 A	30/06/2015	V	85.794,00
AYT CEDULAS CAJAS X, F.T.A.	ES0312342019	AYT.CED.CA.X/3,75 BTA 20250630 B	30/06/2025	3,750	71.171,23
AYT CEDULAS CAJAS XI, F.T.A.	ES0312213004	AYT.CED.CA.XI/VAR BTA 20121127 A	27/11/2012	V	96.578,49
AYT CEDULAS TERRITORIALES CAJAS III, F.T.A.	ES0384957009	AYT.CEDTER.CA.3/5,50 BTA 20110724	24/07/2011	5,500	101.520,00
AYT DEUDA SUBORDINADA I, F.T.A.	ES0312284005	AYT.DEU.SUBD/VAR BTA 20161117 A	17/11/2016	V	81.521,06
AYT DEUDA SUBORDINADA I, F.T.A.	ES0312284013	AYT.DEU.SUBD/VAR BTA 20161117 B	17/11/2016	V	78.427,00
AYT FTPYME II, F.T.A.	ES0312363023	AYT.FTPYME.II/VAR BTA 20321020 T2	20/10/2032	V	67.853,41
AYT FTPYME II, F.T.A.	ES0312363031	AYT.FTPYME.II/VAR BTA 20321020 F3	20/10/2032	V	58.044,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO III, F.T.H.	ES0370143002	AYT.GEN.H.III/VAR BTH 20350715 A	15/07/2035	V	36.180,57
AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, F.T.H.	ES0370150015	AYT.GEN.H.IV/VAR BTH 20360516 B	16/05/2036	V	70.754,09
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, F.T.H.	ES0312300033	AYT.GEN.H.IX/VAR BTH 20390715 C	15/07/2039	V	19.360,97
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, F.T.H.	ES0312343017	AYT.GEN.H.VII/VAR BTH 20380915 A2	15/09/2038	V	32.059,63
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, F.T.H.	ES0312344015	AYT.GEN.H.VIII/VAR BTH 20390515 A2	15/05/2039	V	33.323,92
AYT GOYA HIPOTECARIO III, F.T.A.	ES0312274006	AYT.GOYA.HIP.3/VAR BTA 20521221 A	21/12/2052	V	33.760,12
AYT HIPOTECARIO III, F.T.H.	ES0312369012	AYT.HIP.III/VAR BTH 20330318 B GTIA	21/03/2033	V	34.487,00
AYT HIPOTECARIO MIXTO II, F.T.A.	ES0370151005	AYT.HIP.MIX.II/VAR BTA 20360620 PH1	20/06/2036	V	33.318,99
AYT HIPOTECARIO MIXTO II, F.T.A.	ES0370151013	AYT.HIP.MIX.III/VAR BTA 20360620 PH2	20/06/2036	V	65.359,35
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, F.T.A.	ES0312378013	AYT.HIP.MIX.III/VAR BTA 20380321 B	21/03/2038	V	60.304,32
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, F.T.A.	ES0370153001	KUTXA.HIP.I/VAR BTA 20410422 A GTIA	22/04/2041	V	52.856,25
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, F.T.A.	ES0370154009	KUTXA.HIP.II/VAR BTA 20561015 A	15/10/2056	V	60.512,30
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, F.T.A.	ES0370154017	KUTXA.HIP.II/VAR BTA 20561015 B	15/10/2056	V	46.027,82
AYT PRESTAMOS CONSUMO III, F.T.A.	ES0312372016	AYT.PREST.C.III/VAR BTA 20210115 B	15/01/2021	V	87.870,64
AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS III, F.T.A.	ES0356850000	AYT.INMO.II/VAR BTA 20401210 1 GTIA	10/12/2040	V	11.896,07
AYT.1, F.T.H.	ES0338540000	AYT.1/VAR BTH 20281220 A GTIA	20/12/2028	V	10.381,94
AYT.11, F.T.H.	ES0338541008	AYT.11/VAR BTH 20351015 A GTIA	15/10/2035	V	22.428,68
AYT.11, F.T.H.	ES0338541016	AYT.11/VAR BTH 20351015 B GTIA	15/10/2035	V	79.995,06
AYT.2, F.T.H.	ES0312406012	AYT.2/VAR BTH 20321220 A2 GTIA	21/03/2032	V	12.246,97
AYT.7, PROMOCIONES INMOBILIARIAS I, F.T.A.	ES0390305003	AYT.7.INMO.I/VAR BTA 20350616 GTIA	16/06/2035	V	9.576,45
BANCAJA 10, F.T.A.	ES0312872015	BANCAJA10/VAR BTA 20500522 A2 GTIA	22/05/2050	V	58.913,01
BANCAJA 10, F.T.A.	ES0312872031	BANCAJA10/VAR BTA 20500522 B GTIA	22/05/2050	V	41.146,36
BANCAJA 11, F.T.A.	ES0312867015	BANCAJA.11/VAR BTA 20500427 A2 GTIA	27/04/2050	V	65.026,39
BANCAJA 11, F.T.A.	ES0312867056	BANCAJA.11/VAR BTA 20500427 D GTIA	27/04/2050	V	29.844,70
BANCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0312883004	BANCAJA.4/VAR BTH 20340618 A GTIA	18/06/2034	V	19.255,66
BANCAJA 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312885025	BANCAJA.6/VAR BTA 20360220 B GTIA	20/02/2036	V	40.107,77
BANCAJA 7, F.T.A.	ES0312886049	BANCAJA.7/VAR BTA 20361125 D GTIA	25/11/2036	V	60.609,03
BANCAJA 8, F.T.A.	ES0312887005	BANCAJA.8/VAR BTA 20371025 A GTIA	25/10/2037	V	33.255,63
BANCAJA 8, F.T.A.	ES0312887021	BANCAJA.8/VAR BTA 20371025 C GTIA	25/10/2037	V	42.100,00
BANCAJA 9, F.T.A.	ES0312888011	BANCAJA.9/VAR BTA 20430925 A2 GTIA	25/09/2043	V	48.142,84
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211213	BBVA/VAR BO 20110622	22/06/2011	V	49.836,75
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211304	BBVA/5,00 BOSUBDCONV 20141015	15/10/2014	5,000	1.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211338	BBVA/VAR BOESTR 20140812 7	12/08/2014	V	43.029,73
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211361	BBVA/VAR BOESTR 20130812 11	12/08/2013	V	48.925,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211379	BBVA/VAR BOESTR 20130812 12	12/08/2013	V	48.941,61
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211395	BBVA/VAR BOESTR 20141104 15	04/11/2014	V	47.725,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211403	BBVA/VAR BOESTR 20151019 16	19/10/2015	V	49.693,75
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211411	BBVA/VAR BOESTR 201111013 17	13/10/2011	V	49.712,50
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211429	BBVA/VAR BOESTR 20131029 18	29/10/2013	V	49.640,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211437	BBVA/VAR BOESTR 20131029 19	29/10/2013	V	49.772,50
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211445	BBVA/VAR BOESTR 20151029 20	29/10/2015	V	49.999,67
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211452	BBVA/VAR BOESTR 20120515 21	15/02/2011	V	50.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211460	BBVA/VAR BOESTR 20131112 22	12/11/2013	V	50.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211478	BBVA/VAR BOESTR 20131118 23	18/11/2013	V	50.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211486	BBVA/VAR BOESTR 20131125 24	25/11/2013	V	50.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211494	BBVA/VAR BOESTR 20141222 26	22/12/2014	V	49.975,00
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0313377014	BCO.COOP.ESP/3,125 BO 20120402 GTIA	02/04/2012	3,125	49.566,04
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0313377030	BCO.COOP.ESP/3,125 BO 20150122 GTIA	22/01/2015	3,125	48.747,48
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860134	SAB/VAR BO 20111026	26/10/2011	V	98.206,26
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860233	SAB/4,375 BO 20120522	22/05/2012	4,375	101.339,09
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860241	SAB/VAR BOSUBDCONV 20130721	21/07/2013	V	755,79
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860258	SAB/VAR BO 20120220	20/02/2012	V	49.136,96

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860290	SAB/7,75 BOSUBDCONV 20131110	10/11/2013	7,750	3,56
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0313980015	BVA/VAR BO 20110721	21/07/2011	V	49.029,49
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0313980023	BVA/VAR BO 20120223	23/02/2012	V	47.369,13
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0313580120	GUI/VAR BO 20110321	21/03/2011	V	99.470,70
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0313580138	GUI/2,375 BO 20121125 GTIA	30/11/2012	2,375	49.283,33
BANCO PASTOR, S.A.	ES0313770077	PAS/3,00 BO 20120302 GTIA	02/03/2012	3,000	49.893,78
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0313790000	POP/3,00 BO 20120223 GTIA	23/02/2012	3,000	49.835,14
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0313790018	POP/VAR BO 20110406 CREC	06/04/2011	V	100.000,00
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0313790026	POP/3,00 BO 20120424 GTIA	24/04/2012	3,000	49.967,89
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0313260053	BCH/VAR BO SUBD 20110527	27/05/2011	V	6,39
BANKINTER 10, F.T.A.	ES0313529010	BKT.10/VAR BTA 20430621 A2 GTIA	21/06/2043	V	46.204,38
BANKINTER 11, F.T.H.	ES0313714034	BKT.11/VAR BTH 20480821 C GTIA	21/08/2048	V	30.902,00
BANKINTER 13, F.T.A.	ES0313270011	BKT.13/VAR BTA 20490717 A2 GTIA	17/07/2049	V	62.433,26
BANKINTER 13, F.T.A.	ES0313270029	BKT.13/VAR BTA 20490717 B GTIA	17/07/2049	V	74.898,07
BANKINTER 2 PYME, F.T.A.	ES0313716013	BKT.2.PYME/VAR BTA 20430516 A2 GTIA	16/05/2043	V	34.448,19
BANKINTER 2 PYME, F.T.A.	ES0313716039	BKT.2.PYME/VAR BTA 20430516 C GTIA	16/05/2043	V	43.599,00
BANKINTER 2, F.T.H.	ES0313800031	BKT.2/VAR BTH 20340722 A4 GTIA	22/07/2034	V	21.036,72
BANKINTER 4, F.T.H.	ES0313919005	BKT.4/VAR BTH 20381112 A GTIA	12/11/2038	V	27.478,52
BANKINTER 4, F.T.H.	ES0313919021	BKT.4/VAR BTH 20381112 C GTIA	12/11/2038	V	29.135,94
BANKINTER 6, F.T.A.	ES0313546006	BKT.6/VAR BTA 20380826 A GTIA	26/08/2038	V	34.590,64
BANKINTER 6, F.T.A.	ES0313546014	BKT.6/VAR BTA 20380826 B GTIA	26/08/2038	V	53.474,74
BANKINTER 8, F.T.A.	ES0313548002	BKT.8/VAR BTA 20401215 A GTIA	15/12/2040	V	33.655,02
BANKINTER 9, F.T.A.	ES0313814057	BKT.9/VAR BTA 20420716 A2T GTIA	16/07/2042	V	51.764,86
BANKINTER 9, F.T.A.	ES0313814073	BKT.9/VAR BTA 20420716 CT GTIA	16/07/2042	V	76.580,00
BANKINTER, S.A.	ES0313679435	BKT/VAR BO 20110601	01/06/2011	V	99.439,94
BANKINTER, S.A.	ES0313679443	BKT/VAR BO 20120621	21/06/2012	V	96.218,48
BANKINTER, S.A.	ES0313679450	BKT/3,00 BO 20120224 GTIA	24/02/2012	3,000	100.459,68
BANKINTER, S.A.	ES0313679476	BKT/VAR BO 20120615 II GTIA	15/06/2012	V	726.739,60
BANKINTER, S.A.	ES0313679484	BKT/VAR BO 20130115	15/01/2013	V	48.110,97
BBK BANK CAJASUR, S.A.U.	ES0364730020	CAJASUR/3,17 BO 20120709 GTIA	09/07/2012	3,170	49.799,07
BBVA AUTOS 1, F.T.A.	ES0314204027	BBVA.AUTOS.1/VAR BTA 20160620 C	20/06/2016	V	95.413,55
BBVA CONSUMO 1, F.T.A.	ES0333763003	BBVA.CONSUMO.1/VAR BTA 20200120 A	20/01/2020	V	24.269,14
BBVA CONSUMO 1, F.T.A.	ES0333763011	BBVA.CONSUMO.1/VAR BTA 20200120 B	20/01/2020	V	86.019,10
BBVA CONSUMO 4, F.T.A.	ES0313523005	BBVA.CONSUMO.4/VAR BTA 20230623 A	23/06/2023	V	78.937,97
BBVA CONSUMO 5, F.T.A.	ES0313537005	BBVA.CONSUMO.5/VAR BTA 20251121	21/11/2025	V	100.000,00
BBVA HIPOTECARIO 3, F.T.A.	ES0314227010	BBVA.HIP.3/VAR BTA 20381121 A2 GTIA	12/11/2038	V	28.781,44
BBVA LEASING 1, F.T.A.	ES0314209034	BBVA.LEASING.1/VAR BTA 20310526 C	26/05/2031	V	36.027,50
BBVA RMBS 1, F.T.A.	ES0314147036	BBVA.RMBS1/VAR BTA 20500619 B GTIA	19/06/2050	V	64.972,30
BBVA RMBS 2, F.T.A.	ES0314148018	BBVA.RMBS2/VAR BTA 20500917 A2 GTIA	17/09/2050	V	64.533,65
BBVA RMBS 3, F.T.A.	ES0314149008	BBVA.RMBS3/VAR BTA 20600220 A1 GTIA	20/02/2060	V	34.863,73
BBVA SENIOR FINANCE, S.A.U.	ES0325467316	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20121112 34	12/11/2012	V	33.667,91
BBVA SENIOR FINANCE, S.A.U.	ES0325467456	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20130115	15/01/2013	C	42.370,74
BBVA SENIOR FINANCE, S.A.U.	ES0325467498	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20130115 53	15/01/2013	V	37.740,45
BBVA SENIOR FINANCE, S.A.U.	ES0325467589	BBVA.SR.FIN/3,60 BOESTR 20130401 62	01/04/2013	3,600	211.493,84
BBVA SENIOR FINANCE, S.A.U.	ES0325467647	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20140623 68	23/06/2014	V	55.587,67
BBVA-3 FTPYME, F.T.A.	ES0310110020	BBVA3-PYME/VAR BTA 20280421 B GTIA	21/04/2028	V	42.596,97
BBVA-4 PYME, F.T.A.	ES0370458038	BBVA4.PYME/VAR BTA 20380819 C GTIA	19/08/2038	V	32.696,69
BBVA-6 FTPYME, F.T.A.	ES0370460000	BBVA6.PYME/VAR BTA 20460322 A1	22/03/2046	V	20.779,22
BBVA-6 FTPYME, F.T.A.	ES0370460034	BBVA6.PYME/VAR BTA 20460322 C	22/03/2046	V	45.530,00
BILBAO BIZKAIA KUTXA	ES0314100068	BBK/4,38 BO 20150928	28/09/2015	4,380	99.066,32
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080086	BPEF/VAR BO 20110118	18/01/2011	V	99.883,98
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080144	BPEF/VAR BO 20120208	08/02/2012	V	97.549,12
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080193	BPEF/4,165 BO 20131029 2	29/10/2013	4,165	50.000,00
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080201	BPEF/4,50 BO 20131130 3	30/11/2013	4,500	50.000,00
C.A. Y M.P. DEL CIRCULO CATOLICO DE OBREROS DE BL	ES0315134009	CAJACIRCULO/VAR BO 20120308	08/03/2012	V	48.597,50
CABILDO INSULAR DE GRAN CANARIA	ES0315301079	CBDO.G.C./0,75 BO 20111124	24/11/2011	0,750	993,36
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0314843238	CAIXAGALICIA/VAR BO 20111108	08/11/2011	V	48.415,00
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0314843303	CAIXAGALICIA/3,25 BO 20120417 GTIA	17/04/2012	3,250	50.075,79
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0314843329	CAIXAGALICIA/3,00 BO 20141103 GTIA	03/11/2014	3,000	48.699,79
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0314958028	CAIXANOVA/VAR BO 20110314	14/03/2011	V	49.712,95
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0314958036	CAIXANOVA/VAR BO 20120302	02/03/2012	V	48.178,82
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0314958044	CAIXANOVA/VAR BO 20110604	04/06/2011	V	49.720,10
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0314958051	CAIXANOVA/3,125 BO 20120319 GTIA	19/03/2012	3,125	50.273,41
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0314958069	CAIXANOVA/3,125 BO 20150415 GTIA	15/04/2015	3,125	47.862,70
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0314840101	CA.CATALUNYA/VAR BO 20110718	18/07/2011	V	98.234,12
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0314840168	CA.CATALUNYA/3,00 BO 20120305 GTIA	05/03/2012	3,000	49.666,30
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0314840176	CA.CATALUNYA/3,00 BO 20120507 GTIA	07/05/2012	3,000	49.788,31
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0314840184	CA.CATALUNYA/3,00 BO 20141029 GTIA	29/10/2014	3,000	48.264,28
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0318538016	CATALUNYA.CAIXA/VAR BO 20121108	08/02/2011	V	50.000,00
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0318538024	CATALUNYA.CAIXA/VAR BOESTR 20131129	29/11/2013	V	49.947,55
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0314966146	CA.PENEDES/2,875 BO 20120622 GTIA	22/06/2012	2,875	50.054,50
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0314966187	CA.PENEDES/VAR BO 20150506 GTIA	06/05/2015	V	46.821,47
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0314846058	CA.LAIETANA/4,35 BO 20150629 GTIA	29/06/2015	4,350	50.993,78
CAIXA PENEDES 1 TDA, F.T.A.	ES0313252001	CA.PENEDES1.TDA/VAR BTA 20430128 A	28/01/2043	V	53.294,04
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0314826068	CAJASTUR/3,50 BO 20131008 GTIA	08/10/2013	3,500	49.929,62
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES0315530040	CA.RIOJA/VAR BO 20120222	22/02/2012	V	97.104,58
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0314600109	CA.MURCIA/VAR BO 20120326 GTIA	26/03/2012	V	49.623,33
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0314600141	CA.MURCIA/3,262 BO 20131031 GTIA	31/10/2013	3,262	50.000,00
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0314600158	CA.MURCIA/4,00 BO 20131120 GTIA	20/11/2013	4,000	49.930,18
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0314975022	CA.CANTABRIA/VAR BO 20120412	12/04/2012	V	47.491,21
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0314977101	BANCAJA/3,95 BO 20110430	30/04/2011	3,950	600,01
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0314977119	BANCAJA/3,95 BO 20110601	01/06/2011	3,950	600,01
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0314977242	BANCAJA/VAR BO 20110510	10/05/2011	V	98.756,93
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0314977259	BANCAJA/VAR BO 20120124	24/01/2012	V	96.727,90

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0314977267	BANCAJA/VAR BO 20120321	21/03/2012	V	95.855,19
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0314977275	BANCAJA/3,00 BO 20120312 GTIA	12/03/2012	3,000	50.078,08
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0314977317	BANCAJA/3,375 BO 20120427 GTIA	27/04/2012	3,375	50.486,99
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0314977325	BANCAJA/3,00 BO 20120511 GTIA	11/05/2012	3,000	49.781,65
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0314977341	BANCAJA/2,375 BO 20120918 GTIA	18/09/2012	2,375	49.648,94
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0314977358	BANCAJA/3,00 BO 20141027 GTIA	27/10/2014	3,000	47.895,11
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0314977366	BANCAJA/3,125 BO 20150121 GTIA	21/01/2015	3,125	48.903,56
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0314977374	BANCAJA/VAR BO 20140430 GTIA	30/04/2014	V	48.548,54
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0315308199	CA.VITAL/VAR BO 20120323	23/03/2012	V	49.950,08
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0315308207	CA.VITAL/2,479 BO 20120924 GTIA	24/09/2012	2,479	49.505,94
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0315308215	CA.VITAL/VAR BO 20130327	27/03/2013	V	50.000,00
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400062	CAM/VAR BO 20110203	03/02/2011	V	99.490,84
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400070	CAM/VAR BO 20120515	15/05/2012	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400088	CAM/VAR BO 20120412	12/04/2012	V	100.056,82
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400096	CAM/3,125 BO 20120326 GTIA	26/03/2012	3,125	50.070,19
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400104	CAM/3,25 BO 20120427 GTIA	27/04/2012	3,250	50.448,33
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400112	CAM/VAR BO 20111108 GTIA	08/11/2011	V	49.685,11
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400120	CAM/2,875 BO 20120514 GTIA	14/05/2012	2,875	50.064,60
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400146	CAM/3,00 BO 20120529 GTIA	29/05/2012	3,000	49.971,55
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400187	CAM/3,00 BO 20141112 GTIA	12/11/2014	3,000	48.770,43
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400195	CAM/VAR BO 20141201 GTIA	01/12/2014	V	46.537,20
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES0314961063	CA.BURGOS/VAR BO 20110131	31/01/2011	V	99.735,65
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950348	CA.MADRID/5,125 BO 20110411	11/04/2011	5,125	50.513,55
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950454	CA.MADRID/3,125 BO 20120220 GTIA	20/02/2012	3,125	50.255,94
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950470	CA.MADRID/2,875 BO 20120416 GTIA	16/04/2012	2,875	49.962,93
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950538	CA.MADRID/3,625 BO 20110629	29/06/2011	3,625	50.245,47
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950587	CA.MADRID/2,25 BO 20110916	16/09/2011	2,250	49.634,61
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950652	CA.MADRID/VAR BO 20130429 CREC	29/01/2011	V	50.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950660	CA.MADRID/3,875 BO 20131130 GTIA	30/11/2013	3,875	49.510,98
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950678	CA.MADRID/4,375 BO 20151130 GTIA	30/11/2015	4,375	49.522,58
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950686	CA.MADRID/VAR BO 20131130	30/11/2013	V	49.962,73
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0314965015	CAN/2,798 BO 20110225 GTIA	25/02/2011	2,798	50.171,75
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0314959075	CA.SEGOVIA/2,50 BO 20121026 GTIA	26/10/2012	2,500	49.285,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES0314954068	IBERCAJA/VAR BO 20110209	09/02/2011	V	99.796,81
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0313249007	CA.GIRONA/VAR BO 20120322	22/03/2012	V	48.200,76
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0313249049	CA.GIRONA/3,09 BO 20120619 GTIA	19/06/2012	3,090	49.897,19
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0313249056	CA.GIRONA/2,512 BO 20121026 GTIA	26/10/2012	2,512	49.349,50
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0314970098	LACAIXA/3,375 BO 20120203 GTIA	03/02/2012	3,375	50.492,14
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0314970163	LACAIXA/3,75 BO 20131105	05/11/2013	3,750	49.813,40
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA, (ES0314854128	CAJADUERO/3,00 BO 20150504 GTIA	04/05/2015	3,000	47.650,00
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA, (ES0315474447	CA.ESPAÑA/VAR BO 20121122	22/11/2012	V	972,89
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES0314982044	CA.GRANADA/VAR BO 20111202 GTIA	02/12/2011	V	49.517,50
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0314983059	LA.CAJA/VAR BO 20110518 GTIA	18/05/2011	V	49.872,50
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA DE	ES0315306003	CR.NAVARRA/VAR BO 20111124	24/11/2011	V	46.995,25
CAJAMAR CAJA RURAL, S. COOP. DE CREDITO	ES0314601016	CAJAMAR/VAR BO 20110714	14/07/2011	V	49.275,00
CAJAMAR CAJA RURAL, S. COOP. DE CREDITO	ES0314601024	CAJAMAR/3,125 BO 20120330 GTIA	30/03/2012	3,125	50.054,91
CAJAMAR CAJA RURAL, S. COOP. DE CREDITO	ES0314601057	CAJAMAR/VAR BO 20130503 GTIA	03/05/2013	V	48.885,12
CEAMI GUARANTEED BONDS I, F.T.A.	ES0315944001	CEAMI.BONDS.I/3,125 BTA 20120622	22/06/2012	3,125	49.739,35
CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 3, F.T.A.	ES0318822006	CED.POP.3/4,25 BTA 20170426 GTIA	26/04/2017	4,250	97.672,49
CEDULAS TDA 10, F.T.A.	ES0318823004	CED.TDA.10/VAR BTA 20110307 A GTIA	07/03/2011	V	26.858,37
CEDULAS TDA 19, F.T.A.	ES0315945008	CED.TDA.19/2,25 BTA 20130201 A GTIA	01/02/2013	2,250	42.557,99
CEDULAS TDA 2, F.T.A.	ES0317019000	CED.TDA.2/4,50 BTA 20131126 GTIA	26/11/2013	4,500	98.535,61
CEDULAS TDA 3, F.T.A.	ES0317043000	CED.TDA.3/4,38 BTA 20160303 1 GTIA	03/03/2016	4,375	95.841,71
CEDULAS TDA 5, F.T.A.	ES0317045005	CED.TDA.5/4,13 BTA 20191129 A GTIA	29/11/2019	4,125	85.752,17
CEDULAS TDA 6, F.T.A.	ES0317046003	CED.TDA.6/3,88 BTA 20250523 GTIA	23/05/2025	3,875	70.907,02
CM BANCAJA 1, F.T.A.	ES0379349014	CM BANCAJA 1/VAR BTA 20361222 B	22/12/2036	V	75.846,44
CONSUMO BANCAJA 1, F.T.A.	ES0323633000	CONS.BANCAJA.1/VAR BTA 20200526 A	26/05/2020	V	14.874,73
CONSUMO BANCAJA 1, F.T.A.	ES0323633026	CONS.BANCAJA.1/VAR BTA 20200526 C	26/05/2020	V	20.533,82
CRITERIA CAIXACORP, S.A.	ES0340609009	CR/4,125 BO 20141120	20/11/2014	4,125	49.622,17
EDT FTPYME PASTOR 3, F.T.A.	ES0328421005	EDT.PYME.PAS.3/VAR BTA 20390119 A1	19/01/2039	V	4.037,56
EDT FTPYME PASTOR 3, F.T.A.	ES0328421039	EDT.PYME.PAS.3/VAR BTA 20390119 C	19/01/2039	V	28.500,00
ENAGAS, S.A.	ES0330960008	ENG/3,25 BO 20120706	06/07/2012	3,250	50.856,76
ENDESA CAPITAL, S.A.U.	ES0330991003	ELE.CAP/VAR BO 20120705	05/07/2012	V	49.397,29
FERGO AISA, S.A.	ES0306585029	AISA/5,00 BO 20110814	14/08/2011	5,000	1.001,58
FINANCAT 1, F.T.A.	ES0338002027	FINANCAT.1/VAR BTA 20231015 C GTIA	15/10/2023	V	18.254,12
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER CON	ES0338057021	SAN.CONS.AUTO06/VAR BTA 20161020 C	20/10/2016	V	88.643,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER CON	ES0338057039	SAN.CONS.AUTO06/VAR BTA 20161020 D	20/10/2016	V	34.496,08
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER CON	ES0337709002	SAN.AUTO.07-1/VAR BTA 20220920 A	20/09/2022	V	31.811,94
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER CON	ES0337709010	SAN.AUTO.07-1/VAR BTA 20220920 B	20/09/2022	V	95.840,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMP	ES0382041012	SAN.EMPR.1/VAR BTA 20381104 A2 GTIA	04/11/2038	V	16.281,24
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMP	ES0382041020	SAN.EMPR.1/VAR BTA 20381104 B GTIA	04/11/2038	V	93.700,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMP	ES0382041038	SAN.EMPR.1/VAR BTA 20381104 C GTIA	04/11/2038	V	90.570,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMP	ES0338058011	SAN.EMPR.2/VAR BTA 20500623 A2 GTIA	23/06/2050	V	27.583,50
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMP	ES0338058029	SAN.EMPR.2/VAR BTA 20500623 B GTIA	23/06/2050	V	90.180,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMP	ES0338058037	SAN.EMPR.2/VAR BTA 20500623 C GTIA	23/06/2050	V	88.400,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMP	ES0337710034	SAN.EMPR.3/VAR BTA 20491016 B GTIA	16/10/2049	V	83.910,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMP	ES0337710042	SAN.EMPR.3/VAR BTA 20491016 C GTIA	16/10/2049	V	79.680,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIPC	ES0382042002	SAN.HIP.2/VAR BTA 20490118 A GTIA	18/01/2049	V	47.926,46
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIPC	ES0382042010	SAN.HIP.2/VAR BTA 20490118 B GTIA	18/01/2049	V	66.270,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIPC	ES0382042028	SAN.HIP.2/VAR BTA 20490118 C GTIA	18/01/2049	V	57.460,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIPC	ES0338093034	SAN.HIP.3/VAR BTA 20500118 B GTIA	18/01/2050	V	47.670,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIPC	ES0338093042	SAN.HIP.3/VAR BTA 20500118 C GTIA	18/01/2050	V	34.265,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 11	ES0338340005	UCI.11/VAR BTA 20410915 A GTIA	15/09/2041	V	29.139,35
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 14	ES0338341003	UCI.14/VAR BTA 20430620 A GTIA	20/06/2043	V	37.224,61
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 14	ES0338341029	UCI.14/VAR BTA 20430620 C GTIA	20/06/2043	V	17.996,36

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 16	ES0338186010	UCI.16/VAR BTA 20490616 A2 GTIA	16/06/2049	V	63.034,52
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 16	ES0338186036	UCI.16/VAR BTA 20490616 C GTIA	16/06/2049	V	29.000,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 17	ES0337985016	UCI.17/VAR BTA 20491217 A2 GTIA	17/12/2049	V	69.241,10
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 19	ES0337947008	UCI.19/VAR BTA 20520519 A GTIA	19/05/2052	V	53.621,83
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 8	ES0338446000	UCI.8/VAR BTA 20331218 A GTIA	18/12/2033	V	14.049,91
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 9	ES0338222005	UCI.9/VAR BTA 20350619 A GTIA	19/06/2035	V	19.082,99
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, FTPYME SANTAN	ES0339773022	PYME.SAN.1/VAR BTA 20341115 B2	15/11/2034	V	46.667,16
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, FTPYME SANTAN	ES0339773030	PYME.SAN.1/VAR BTA 20341115 C	15/11/2034	V	91.999,84
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, FTPYME SANTAN	ES0338048020	PYME.SAN.2/VAR BTA 20370418 C GTIA	18/04/2037	V	93.100,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, FTPYME SANTAN	ES0338048038	PYME.SAN.2/VAR BTA 20370418 D GTIA	18/04/2037	V	91.220,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, HIPOTEBANSA X	ES0338356019	HIPOTEBANSA X/VAR BTA 20340318 B	18/03/2034	V	54.428,08
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, SANTANDER FIN	ES0382043018	SAN.FINAN.1/VAR BTA 20350720 B GTIA	20/07/2035	V	93.725,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, SANTANDER FIN	ES0382043026	SAN.FINAN.1/VAR BTA 20350720 C GTIA	20/07/2035	V	92.580,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, UCI 15	ES0380957003	UCI.15/VAR BTA 20481218 A GTIA	18/12/2048	V	37.224,85
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA BANESTO 4	ES0339774004	BANESTO.4/VAR BTH 20380315 A GTIA	15/03/2038	V	26.580,17
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 10	ES0338146006	UCI.10/VAR BTH 20360622 A GTIA	22/06/2036	V	22.843,95
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 12	ES0338147004	UCI.12/VAR BTH 20391215 A GTIA	15/12/2039	V	35.482,31
FTPYME BANCAJA 3, F.T.A.	ES0304501036	PYME.BANCAJA.3/VAR BTA 20371213 B	13/12/2037	V	40.334,55
FTPYME TDA CAM 2, F.T.A.	ES0339758015	PYME.TDA.CAM.2/VAR BTA 20420726 1CA	26/07/2042	V	73.282,74
FTPYME TDA CAM 2, F.T.A.	ES0339758023	PYME.TDA.CAM.2/VAR BTA 20420726 2SA	26/07/2042	V	31.367,36
FTPYME TDA CAM 4, F.T.A.	ES0339759013	PYME.TDA.CAM.4/VAR BTA 20450928 A2	28/09/2045	V	27.886,66
FTPYME TDA CAM 4, F.T.A.	ES0339759039	PYME.TDA.CAM.4/VAR BTA 20450928 B	28/09/2045	V	77.110,00
GAT FTGENCAT 2005, F.T.A.	ES0341096024	GAT.GENCAT.05/VAR BTA 20400204 B	04/02/2040	V	69.480,60
GC FTGENCAT CAIXA TARRAGONA 1, F.T.A.	ES0341082032	GC.CAIXA.TAR.1/VAR BTA 20630630 C	30/06/2063	V	36.788,90
GC FTPYME PASTOR 2, F.T.A.	ES0341168021	GC.PYME.PAS.2/VAR BTA 20371031 BS	20/01/2011	V	4.930,25
GC FTPYME PASTOR 2, F.T.A.	ES0341168047	GC.PYME.PAS.2/VAR BTA 20371031 D	20/01/2011	V	99.450,00
GC FTPYME PASTOR 4, F.T.A.	ES0332233016	GC.PYME.PAS.4/VAR BTA 20450715 A2	15/07/2045	V	19.357,68
GC FTPYME PASTOR 6, F.T.A.	ES0341083014	GC.PYME.PAS.6/VAR BTA 20511030 AG	30/10/2051	V	87.047,94
GC FTPYME SABADELL 5, F.T.A.	ES0332234014	GC.PYME.SAB.5/VAR BTA 20390331 A2	31/03/2039	V	26.410,32
HIPOCAT 10, F.T.A.	ES0345671053	HIPOCAT 10/VAR BTA 20391024 C GTIA	24/10/2039	V	80.934,58
HIPOCAT 15, F.T.A.	ES0345675005	HIPOCAT.15/VAR BTA 20480229 A GTIA	29/02/2048	V	54.196,38
HIPOCAT 17, F.T.A.	ES0345677001	HIPOCAT.17/VAR BTA 20520920 A GTIA	20/09/2052	V	64.556,30
HIPOCAT 8, F.T.A.	ES0345784013	HIPOCAT 8/VAR BTA 20380315 A2 GTIA	15/03/2038	V	43.165,73
HIPOCAT 9, F.T.A.	ES0345721015	HIPOCAT.9/VAR BTA 20380715 A2A GTIA	15/07/2038	V	60.309,97
IM BANCO POPULAR FTPYME 1, F.T.A.	ES0347847016	IM.POP.PYME/VAR BTA 20430424 AG	24/04/2043	V	52.868,45
IM CAJA LABORAL 1, F.T.A.	ES0347565006	IM.CA.LABORAL.1/VAR BTA 20491024 A	24/10/2049	V	51.621,78
IM CAJAMAR 3, F.T.A.	ES0347783005	IM.CAJAMAR.3/VAR BTA 20480922 A	22/09/2048	V	47.793,81
IM GRUPO BANCO POPULAR, F.T.A.	ES0347858005	IM.CEDULAS 1/4,25 BTA 20140212 GTIA	12/02/2014	4,250	97.206,78
IM CEDULAS 10, F.T.A.	ES0349045007	IM.CED.10/4,50 BTA 20220221 GTIA	21/02/2022	4,500	87.566,80
IM CEDULAS 2, F.T.A.	ES0347859003	IM.CEDULAS 2/4,50 BTA 20140611 A	11/06/2014	4,500	100.007,99
IM CEDULAS 3, F.T.A.	ES0347852008	IM.CED.3/4,00 BTA 20141119 GTIA	19/11/2014	4,000	97.000,00
IM CEDULAS 5, F.T.A.	ES0347849004	IM.CEDULAS 5/3,50 BTA 20200615 GTIA	15/06/2020	3,500	82.569,97
IM CEDULAS 7, F.T.A.	ES0347784003	IM.CED.7/4,00 BTA 20210331 GTIA	31/03/2021	4,000	82.940,58
IM CEDULAS 9, F.T.A.	ES0347785000	IM.CED.9/4,25 BTA 20160609 GTIA	09/06/2016	4,250	90.600,00
IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, F.T.A.	ES0347843049	IM.POP.EMP.1/VAR BTA 20330321 D	21/03/2033	V	52.156,01
IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I, F.T.A.	ES0347844062	IM.POP.PYME.I/VAR BTA 20390921 C	21/09/2039	V	51.220,00
IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME II, F.T.A.	ES0347844070	IM.POP.PYME.II/VAR BTA 20390921 D	21/09/2039	V	48.728,70
IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME II, F.T.A.	ES0347786040	IM.POP.PYME.II/VAR BTA 20410124 C	24/01/2041	V	67.596,00
IM PASTOR 2, F.T.H.	ES0347861017	IM.PASTOR 2/VAR BTH 20410922 B GTIA	22/09/2041	V	78.400,00
IM PASTOR 3, F.T.H.	ES0347862007	IM.PAS.3/VAR BTH 20430322 A GTIA	22/03/2043	V	33.160,14
IM PASTOR 4, F.T.A.	ES0347854004	IM.PAS.4/VAR BTA 20440322 A GTIA	22/03/2044	V	39.811,18
IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, F.T.A.	ES0347787014	IM.PREST.F.CED./VAR BTA 20220124 B	24/01/2022	V	60.881,26
IM TERRASA MBS 1, F.T.A.	ES0347855001	IM.TERR.MBS.1/VAR BTA 20490724 A	24/07/2049	V	44.741,54
INTERMONEY MASTER CEDULAS, F.T.A.	ES0362859003	INTER.MAST.CED/3,50 BTA 20151202 M1	02/12/2015	3,500	92.123,74
M.P. Y C.A. RONDA, CADIZ, ALMERIA, MALAGA, ANTEQUE	ES0364872038	UNICAJA/VAR BO 20110726	26/07/2011	V	49.815,50
M.P. Y C.A. RONDA, CADIZ, ALMERIA, MALAGA, ANTEQUE	ES0364872095	UNICAJA/3,00 BO 20120618 GTIA	18/06/2012	3,000	49.892,11
M.P. Y C.A. SAN FERNANDO DE GUADALAJARA, HUELVA,	ES0358197012	CAJASOL/3,125 BO 20120427 GTIA	27/04/2012	3,125	50.035,86
M.P. Y C.A. SAN FERNANDO DE GUADALAJARA, HUELVA,	ES0358197053	CAJASOL/3,60 BO 20130628 GTIA	28/06/2013	3,600	50.399,32
MADRID RMBS I, F.T.A.	ES0359091016	MADRID.RMBS.I/VAR BTA 20490622 A2	16/06/2049	V	61.014,03
MADRID RMBS III, F.T.A.	ES0359093012	MADRID.RMBS.III/VAR BTA 20500222 A2	22/02/2050	V	53.093,14
MBS BANCAJA 1, F.T.A.	ES0361794003	MBS.BANCAJA.1/VAR BTA 20351117 A	17/11/2035	V	19.461,77
MBS BANCAJA 1, F.T.A.	ES0361794011	MBS.BANCAJA.1/VAR BTA 20351117 B	17/11/2035	V	35.612,67
MBS BANCAJA 1, F.T.A.	ES0361794029	MBS.BANCAJA.1/VAR BTA 20351117 C	17/11/2035	V	31.831,76
MBS BANCAJA 2, F.T.A.	ES0361795026	MBS.BANCAJA.2/VAR BTA 20380225 C	25/02/2038	V	50.000,00
MBS BANCAJA 3, F.T.A.	ES0361796016	MBS.BANCAJA.3/VAR BTA 20431226 A2	26/12/2043	V	46.777,73
MBS BANCAJA 4, F.T.A.	ES0361797014	MBS.BANCAJA.4/VAR BTA 20500723 A2	23/07/2050	V	51.376,03
MBS BANCAJA 4, F.T.A.	ES0361797048	MBS.BANCAJA.4/VAR BTA 20500723 C	23/07/2050	V	46.150,00
POPULAR CAPITAL, S.A.	ES0370412001	POP.CAP./VAR BOSUBDCANJ 20131023	23/10/2013	V	651,46
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622012	PROG.CED.TDA/4,13 BTA 20210410 A4	10/04/2021	4,125	83.515,02
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622020	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20310410 A6	10/04/2031	4,250	67.238,67
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622038	PROG.CED.TDA/4,00 BTA 20181023 A3	23/10/2018	4,000	87.015,71
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622046	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20270328 A5	28/03/2027	4,250	66.686,89
PYME BANCAJA 5, F.T.A.	ES0372259020	PYME.BANCAJA.5/VAR BTA 20390214 A3	14/02/2039	V	16.658,02
PYME VALENCIA 1, F.T.A.	ES0372241010	PYME.VALENCIA1/VAR BTA 20400323 A2	23/03/2040	V	26.080,43
PYMECAT 3 FTPYME, F.T.A.	ES0372223000	PYMECAT.3/VAR BTA 20520720 A1G GTIA	20/07/2052	V	97.606,86
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, F.T.A.	ES0374273003	RURAL.HIP.GBL.I/VAR BTA 20390118 A	18/01/2039	V	41.271,75
RURAL HIPOTECARIO IV, F.T.H.	ES0358283002	RURAL.HIP.IV/VAR BTH 20330213 A	13/02/2033	V	21.854,02
RURAL HIPOTECARIO IX, F.T.A.	ES0374274019	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 A2	17/02/2050	V	62.790,07
RURAL HIPOTECARIO IX, F.T.A.	ES0374274035	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 B	17/02/2050	V	68.575,78
RURAL HIPOTECARIO IX, F.T.A.	ES0374274043	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 C	17/02/2050	V	47.666,63
RURAL HIPOTECARIO VII, F.T.A.	ES0366366005	RURAL.HIP.VII/VAR BTA 20380315 A1	15/03/2038	V	36.137,66
RURAL HIPOTECARIO VIII, F.T.A.	ES0366367011	RURAL.HIP.VIII/VAR BTA 20440119 A2A	19/01/2044	V	55.222,79
RURAL HIPOTECARIO XI, F.T.A.	ES0323975005	RURAL.HIP.XI/VAR BTA 20530325 A	25/03/2053	V	77.631,83
RURALPYME 2 FTPYME, F.T.A.	ES0374352005	RURALPYME.2/VAR BTA 20300425 A1	25/04/2030	V	22.491,74
RURALPYME 2 FTPYME, F.T.A.	ES0374352039	RURALPYME.2/VAR BTA 20300425 C	25/04/2030	V	82.759,00

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
RURALPYME 3, F.T.A.	ES0366368001	RURALPYME.3/VAR BTA 20410424 A GTIA	24/04/2041	V	29.644,93
SANTANDER EMISORA 150, S.A. UNIPERSONAL	ES0307779001	SAN.EMISORA.150/VAR BOCAN 20121004	04/10/2012	V	3.097,08
SANTANDER HIPOTECARIO I, F.T.A.	ES0309364000	SAN.HIP.I/VAR BTA 20420715 A GTIA	15/07/2042	V	29.486,64
SANTANDER HIPOTECARIO I, F.T.A.	ES0309364018	SAN.HIP.I/VAR BTA 20420715 B GTIA	15/07/2042	V	80.700,00
SANTANDER HIPOTECARIO I, F.T.A.	ES0309364026	SAN.HIP.I/VAR BTA 20420715 C GTIA	15/07/2042	V	71.700,00
SOL-LION, F.T.A.	ES0317104000	SOL-LION/VAR BTA 20470523 A GTIA	23/05/2047	V	86.380,18
TDA 11, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0378014023	TDA.11/VAR BTH 20120726 A3 GTIA	26/07/2012	V	13.488,27
TDA 14-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377978020	TDA 14-MIXTO/VAR BTH 20310126 A3	26/01/2031	V	24.694,51
TDA 14-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377978038	TDA 14-MIXTO/VAR BTH 20310126 B1	26/01/2031	V	68.752,41
TDA 15-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377979002	TDA.15-MIX/VAR BTA 20320628 A1 GTIA	28/06/2032	V	24.145,28
TDA 16-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377973013	TDA.16-MIX/VAR BTA 20350322 B1 GTIA	22/03/2035	V	42.406,23
TDA 16-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377973039	TDA.16-MIX/VAR BTA 20350322 B2 GTIA	22/03/2035	V	36.318,50
TDA 18-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377989027	TDA 18-MIXTO/VAR BTA 20450622 B1	22/06/2045	V	26.662,20
TDA 20-MIXTO, F.T.A.	ES0377981024	TDA.20-MIX/VAR BTA 20360426 A2 GTIA	26/04/2036	V	30.411,75
TDA 22-MIXTO, F.T.A.	ES0377983004	TDA 22-MIXTO/VAR BTA 20460628 A1A	26/10/2046	V	12.606,44
TDA 22-MIXTO, F.T.A.	ES0377983012	TDA 22-MIXTO/VAR BTA 20460628 A1B	28/06/2046	V	76.200,00
TDA 23, F.T.A.	ES0377984002	TDA 23/VAR BTA 20460922 A GTIA	22/09/2046	V	34.860,69
TDA 24, F.T.A.	ES0377952033	TDA.24/VAR BTA 20400622 C GTIA	22/06/2040	V	5.101,30
TDA 28, F.T.A.	ES0377930005	TDA.28/VAR BTA 20501028 A GTIA	28/10/2050	V	50.292,23
TDA 7, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0308184029	TDA.7/VAR BTH 20281117 A3 GTIA	26/01/2011	V	9.007,24
TDA 9, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0308186032	TDA 9/VAR BTH 20171222 B GTIA	22/12/2017	V	75.000,00
TDA CAJAMAR 2, F.T.A.	ES0377965019	TDA.CAJAMAR.2/VAR BTA 20410626 A2	26/06/2041	V	35.216,49
TDA CAJAMAR 2, F.T.A.	ES0377965035	TDA.CAJAMAR.2/VAR BTA 20410626 B	26/06/2041	V	77.731,12
TDA CAM 3, F.T.A.	ES0377990009	TDA.CAM.3/VAR BTA 20330426 A GTIA	26/04/2033	V	27.418,52
TDA CAM 5, F.T.A.	ES0377992005	TDA.CAM.5/VAR BTA 20431026 A GTIA	26/10/2043	V	45.821,29
TDA CAM 6, F.T.A.	ES0377993003	TDA.CAM.6/VAR BTA 20120728 A1 GTIA	28/07/2012	V	25.643,67
TDA CAM 7, F.T.A.	ES0377994019	TDA.CAM.7/VAR BTA 20490226 A2 GTIA	26/02/2049	V	57.846,51
TDA CAM 8, F.T.A.	ES0377966009	TDA.CAM.8/VAR BTA 20490226 A GTIA	26/02/2049	V	50.128,99
TDA IBERCAJA 1, F.T.A.	ES0338450002	TDA IBERCAJA 1/VAR BTA 20350726 A	26/07/2035	V	31.968,13
TDA IBERCAJA 2, F.T.A.	ES0338451000	TDA IBERCAJA 2/VAR BTA 20421026 A	26/10/2042	V	46.794,62
TDA IBERCAJA 3, F.T.A.	ES0338452008	TDA.IBERCAJA.3/VAR BTA 20431228 A	28/12/2043	V	51.671,23
TDA IBERCAJA 5, F.T.A.	ES0377967031	TDA IBERCAJA.5/VAR BTA 20491126 C	26/11/2049	V	32.795,10
TDA TARRAGONA 1, F.T.A.	ES0338455001	TDA.TARRAGONA.1/VAR BTA 20500627 A	27/06/2050	V	60.985,45
TDA TARRAGONA 1, F.T.A.	ES0338455027	TDA.TARRAGONA.1/VAR BTA 20500627 C	27/06/2050	V	33.019,90
VALENCIA HIPOTECARIO 2, F.T.H.	ES0382745000	VALENCIA.HIP.2/VAR BTH 20430124 A	24/01/2043	V	43.097,16
VALENCIA HIPOTECARIO 2, F.T.H.	ES0382745018	VALENCIA.HIP.2/VAR BTH 20430124 B	24/01/2043	V	57.500,00
VALENCIA HIPOTECARIO 3, F.T.A.	ES0382746016	VALENCIA.HIP.3/VAR BTA 20440922 A2	22/09/2044	V	57.031,27
VALENCIA HIPOTECARIO 3, F.T.A.	ES0382746032	VALENCIA.HIP.3/VAR BTA 20440922 C	22/09/2044	V	70.707,49
ZINKIA ENTERTAINMENT, S.A.	ES0384849008	ZNK/9,75 BO 20131112	12/11/2013	9,750	997,59

CEDULAS

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0400230068	BCO.CTO.LOCAL/3,75 CEDTER 20111020	20/10/2011	3,750	101.654,75
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211030	BBVA/4,25 CEDHIP 20130129 GTIA	29/01/2013	4,250	102.457,15
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211048	BBVA/3,50 CEDHIP 20110315 GTIA	15/03/2011	3,500	100.576,57
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211055	BBVA/4,25 CEDHIP 20140715 GTIA	15/07/2014	4,250	101.713,11
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211071	BBVA/4,00 CEDHIP 20250225 GTIA	25/02/2025	4,000	89.539,63
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211089	BBVA/3,50 CEDHIP 20150225 GTIA	25/02/2015	3,500	98.189,67
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211105	BBVA/3,50 CEDHIP 20201007 GTIA	07/10/2020	3,500	92.108,54
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211113	BBVA/3,25 CEDHIP 20160124 GTIA	24/01/2016	3,250	97.953,64
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211121	BBVA/3,50 CEDHIP 20210124 GTIA	24/01/2021	3,500	87.617,69
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211139	BBVA/3,875 CEDHIP 20120531 GTIA	31/05/2012	3,875	102.022,54
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211154	BBVA/3,75 CEDHIP 20131004 GTIA	04/10/2013	3,750	99.482,13
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211162	BBVA/3,75 CEDTER 20111123 GTIA	23/11/2011	3,750	100.946,89
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211170	BBVA/4,25 CEDHIP 20170118 GTIA	18/01/2017	4,250	98.606,06
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211204	BBVA/4,50 CEDTER 20140530 GTIA	30/05/2014	4,500	50.679,54
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211261	BBVA/4,625 CEDTER 20120802 GTIA	02/08/2012	4,625	103.599,44
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211337	BBVA/3,00 CEDHIP 20141009 GTIA	09/10/2014	3,000	48.882,76
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211345	BBVA/3,625 CEDHIP 20170118 GTIA	18/01/2017	3,625	48.699,46
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211352	BBVA/2,50 CEDTER 20131007 GTIA	07/10/2013	2,500	48.299,93
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211378	BBVA/VAR CEDHIP 20140728 GTIA	28/07/2014	V	49.587,26
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211386	BBVA/3,50 CEDHIP 20130726 GTIA	26/07/2013	3,500	50.290,99
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860000	SAB/4,50 CEDHIP 20130429 GTIA	29/04/2013	4,500	101.933,19
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860018	SAB/3,75 CEDHIP 20110126 GTIA	26/01/2011	3,750	100.547,82
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860026	SAB/3,25 CEDHIP 20150615 GTIA	15/06/2015	3,250	95.329,81
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860034	SAB/3,50 CEDHIP 20160119 GTIA	19/01/2016	3,500	96.457,63
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860067	SAB/4,25 CEDHIP 20170124 GTIA	24/01/2017	4,250	95.494,48
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860182	SAB/3,125 CEDHIP 20140120 GTIA	20/01/2014	3,125	97.412,19
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860208	SAB/3,25 CEDHIP 20120910 GTIA	10/09/2012	3,250	49.861,87
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440027	BTO/5,75 CEDHIP 20170327 GTIA	27/03/2017	5,750	109.264,16
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440043	BTO/3,75 CEDHIP 20110223 GTIA	23/02/2011	3,750	100.766,89
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440050	BTO/4,25 CEDHIP 20140916 GTIA	16/09/2014	4,250	100.651,69
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440068	BTO/3,50 CEDHIP 20150127 GTIA	27/01/2015	3,500	98.669,09
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440076	BTO/2,75 CEDHIP 20120907 GTIA	07/09/2012	2,750	99.641,43
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440084	BTO/3,50 CEDHIP 20160118 GTIA	18/01/2016	3,500	91.995,45
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440092	BTO/4,25 CEDHIP 20130712 GTIA	12/07/2013	4,250	102.599,86
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440100	BTO/4,25 CEDHIP 20140221 GTIA	21/02/2014	4,250	102.403,70
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440159	BTO/3,625 CEDHIP 20130604 GTIA	04/06/2013	3,625	100.851,20
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440167	BTO/2,625 CEDHIP 20130228 GTIA	28/02/2013	2,625	49.329,81
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440175	BTO/3,625 CEDHIP 20150907 GTIA	07/09/2015	3,625	97.915,35

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770001	PAS/3,75 CEDHIP 20150304 GTIA	04/03/2015	3,750	96.296,54
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770019	PAS/3,875 CEDHIP 20130920 GTIA	20/09/2013	3,875	99.680,22
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770092	PAS/3,25 CEDHIP 20140317 GTIA	17/03/2014	3,250	96.404,34
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770134	PAS/3,625 CEDHIP 20120924 GTIA	24/09/2012	3,625	99.530,98
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790009	POP/3,00 CEDHIP 20121018 GTIA	18/10/2012	3,000	98.738,29
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790017	POP/4,00 CEDHIP 20161018 GTIA	18/10/2016	4,000	97.000,00
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790058	POP/4,375 CEDHIP 20140616 GTIA	16/06/2014	4,375	49.643,75
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790074	POP/4,125 CEDHIP 20180409 GTIA	09/04/2018	4,125	47.024,31
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790108	POP/3,50 CEDHIP 20130913 GTIA	13/09/2013	3,500	49.755,13
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790116	POP/4,25 CEDHIP 20150930 GTIA	30/09/2015	4,250	49.799,26
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900020	SAN/4,00 CEDTER 20130708 GTIA	08/07/2013	4,000	102.160,59
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900061	SAN/4,50 CEDHIP 20160729 GTIA	29/07/2016	4,500	102.474,95
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900079	SAN/3,25 CEDHIP 20120207 GTIA	07/02/2012	3,250	100.771,37
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900087	SAN/4,00 CEDHIP 20200407 GTIA	07/04/2020	4,000	95.336,83
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900095	SAN/2,50 CEDHIP 20110128 GTIA	28/01/2011	2,500	100.069,29
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900103	SAN/3,125 CEDHIP 20150928 GTIA	28/09/2015	3,125	96.581,97
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900111	SAN/3,50 CEDHIP 20140206 GTIA	06/02/2014	3,500	99.554,81
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900137	SAN/3,75 CEDHIP 20110908 GTIA	08/09/2011	3,750	100.646,97
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900145	SAN/4,125 CEDHIP 20170109 GTIA	09/01/2017	4,125	99.528,09
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900152	SAN/4,25 CEDHIP 20130506 GTIA	06/05/2013	4,250	102.498,33
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900160	SAN/4,625 CEDHIP 20270504 GTIA	04/05/2027	4,625	100.002,58
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900178	SAN/4,50 CEDHIP 20121114 GTIA	14/11/2012	4,500	103.749,49
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900186	SAN/3,875 CEDHIP 20140527 GTIA	27/05/2014	3,875	102.231,27
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900202	SAN/3,125 CEDHIP 20150128 GTIA	28/01/2015	3,125	98.227,00
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900210	SAN/3,625 CEDHIP 20170406 GTIA	06/04/2017	3,625	96.585,33
BANKINTER, S.A.	ES0413679061	BKT/3,25 CEDHIP 20141113 GTIA	13/11/2014	3,250	96.930,41
BANKINTER, S.A.	ES0413679079	BKT/2,625 CEDHIP 20130409 GTIA	09/04/2013	2,625	48.375,09
BANKINTER, S.A.	ES0413679095	BKT/3,75 CEDHIP 20130923 GTIA	23/09/2013	3,750	49.785,60
BARCLAYS BANK, S.A.	ES0413985039	BARCLAYS/VAR CEDHIP 20220927 GTIA	27/09/2022	V	40.102,55
ILBAO BIZKAIA KUTXA	ES0414100026	BBK/3,375 CEDHIP 20140929 GTIA	29/09/2014	3,375	96.443,64
CAIXA DE AFORROS DE GALICIA, VIGO, OURENSE E PON	ES0414843138	CAIXAGALICIA/VAR CEDTER 20110713	13/07/2011	V	99.161,37
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0414840274	CA.CATALUNYA/3,50 CEDHIP 20160307	07/03/2016	3,500	95.686,45
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0414840308	CA.CATALUNYA/4,875 CEDHIP 20170629	29/06/2017	4,875	98.950,63
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0414977357	BANCAJA/3,00 CEDHIP 20130415 GTIA	15/04/2013	3,000	48.751,24
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0415308016	CA.VITAL/3,035 CEDHIP 20131127 GTIA	27/11/2013	3,035	48.714,56
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0415308024	CA.VITAL/2,826 CEDHIP 20121128 GTIA	28/11/2012	2,826	49.710,80
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0415308032	CA.VITAL/3,348 CEDHIP 20120127 GTIA	27/01/2012	3,348	50.176,60
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0414400079	CAM/3,375 CEDHIP 20141022 GTIA	22/10/2014	3,375	47.775,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA	ES0415309006	KUTXA/4,375 CEDHIP 20141105 GTIA	05/11/2014	4,375	49.913,30
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950560	CA.MADRID/5,75 CEDHIP 20160629 GTIA	29/06/2016	5,750	99.310,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950586	CA.MADRID/5,25 CEDHIP 20120301 GTIA	01/03/2012	5,250	102.408,04
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950610	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20110325 GTIA	25/03/2011	3,500	100.625,52
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950628	CA.MADRID/4,00 CEDHIP 20250203 GTIA	03/02/2025	4,000	87.798,97
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950636	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20151214 GTIA	14/12/2015	3,500	95.022,63
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950644	CA.MADRID/4,125 CEDHIP 20360324	24/03/2036	4,125	42.291,73
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950651	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20180525 GTIA	25/05/2018	4,250	46.260,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950669	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20160705 GTIA	05/07/2016	4,250	48.539,30
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950677	CA.MADRID/4,25 CEDTER 20140221 GTIA	21/02/2014	4,250	50.041,29
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950685	CA.MADRID/4,50 CEDHIP 20220426 GTIA	26/04/2022	4,500	48.638,04
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950693	CA.MADRID/5,00 CEDHIP 20190628 GTIA	28/06/2019	5,000	47.748,47
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950776	CA.MADRID/3,625 CEDHIP 20161005	05/10/2016	3,625	44.847,85
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950784	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20141113 GTIA	13/11/2014	3,500	48.454,85
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950826	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20130314 GTIA	14/03/2013	3,500	49.487,97
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES0414954141	IBERCAJA/3,375 CEDHIP 20141127 GTIA	27/11/2014	3,375	48.522,75
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970139	LACAIXA/5,25 CEDHIP 20110405 GTIA	05/04/2011	5,250	101.715,14
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970162	LACAIXA/4,50 CEDHIP 20121121 GTIA	21/11/2012	4,500	103.009,92
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970196	LACAIXA/4,75 CEDHIP 20181031 GTIA	31/10/2018	4,750	99.162,18
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970204	LACAIXA/3,875 CEDHIP 20250217 GTIA	17/02/2025	3,875	86.623,01
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970212	LACAIXA/3,25 CEDHIP 20151005 GTIA	05/10/2015	3,250	96.866,91
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970238	LACAIXA/3,375 CEDHIP 20140630 GTIA	30/06/2014	3,375	49.368,64
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970246	LACAIXA/3,625 CEDHIP 20210118 GTIA	18/01/2021	3,625	45.702,51
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970253	LACAIXA/VAR CEDHIP 20160630 GTIA	30/06/2016	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970295	LACAIXA/4,25 CEDHIP 20170126 GTIA	26/01/2017	4,250	50.402,40
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970303	LACAIXA/4,50 CEDHIP 20220126 GTIA	26/01/2022	4,500	49.165,74
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970311	LACAIXA/3,75 CEDTER 20110913 GTIA	13/09/2011	3,750	50.706,59
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970337	LACAIXA/VAR CEDHIP 20160930 GTIA	30/09/2016	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970352	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170330 GTIA	30/03/2017	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970394	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170930 GTIA	30/09/2017	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970402	LACAIXA/4,625 CEDHIP 20190604 GTIA	04/06/2019	4,625	46.512,48
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970428	LACAIXA/VAR CEDHIP 20120330 GTIA	30/03/2012	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970444	LACAIXA/VAR CEDHIP 20110509 GTIA	09/05/2011	V	49.919,70
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970519	LACAIXA/3,75 CEDHIP 20140526 GTIA	26/05/2014	3,750	49.957,78
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970535	LACAIXA/3,50 CEDHIP 20160331 GTIA	31/03/2016	3,500	48.383,41
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970550	LACAIXA/2,50 CEDTER 20130429 GTIA	29/04/2013	2,500	48.956,84
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970584	LACAIXA/3,125 CEDHIP 20130916 GTIA	16/09/2013	3,125	49.582,46
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970618	LACAIXA/3,737 CEDHIP 20151015 GTIA	15/10/2015	3,737	50.000,00
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA,	(ES0414854036	CAJADUERO/VAR CEDHIP 20120629 GTIA	29/06/2012	V	972,53
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA,	(ES0414854044	CAJADUERO/VAR CEDHIP 20120929 GTIA	29/09/2012	V	967,06
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA,	(ES0414854085	CAJADUERO/3,00 CEDHIP 20130610 GTIA	10/06/2013	3,000	995,20
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA,	(ES0415474305	CA.ESPAÑA/3,00 CEDHIP 20150603 GTIA	03/06/2015	3,000	961,76
CAJAMAR CAJA RURAL, S. COOP. DE CREDITO	ES0414601023	CAJAMAR/3,50 CEDHIP 20141023 GTIA	23/10/2014	3,500	95.316,87
M.P. Y C.A. RONDA, CADIZ, ALMERIA, MALAGA, ANTEQUE	ES0458759000	UNICAJA/4,375 CEDHIP 20151014 GTIA	14/10/2015	4,375	49.856,70
M.P. Y C.A. RONDA, CADIZ, ALMERIA, MALAGA, ANTEQUE	ES0464872060	UNICAJA/3,125 CEDHIP 20141006 GTIA	06/10/2014	3,125	47.980,66
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0413495005	SAN.CONS.FIN/3,875 CEDHIP 20160323	23/03/2016	3,875	101.050,00

PAGARÉS

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCA MARCH, S.A.	ES05130453O5	BCA.MARCH/PAG 20110218	18/02/2011	C	995,90
BANCA MARCH, S.A.	ES05130454D6	BCA.MARCH/PAG 20110331	31/03/2011	C	991,81
BANCA MARCH, S.A.	ES05130455L6	BCA.MARCH/PAG 20110126	26/01/2011	C	997,73
BANCA MARCH, S.A.	ES05130456N0	BCA.MARCH/PAG 20110506	06/05/2011	C	988,89
BANCA MARCH, S.A.	ES05130456P5	BCA.MARCH/PAG 20110510	10/05/2011	C	988,77
BANCA MARCH, S.A.	ES05130456Q3	BCA.MARCH/PAG 20111111	11/11/2011	C	979,34
BANCA MARCH, S.A.	ES05130456S9	BCA.MARCH/PAG 20110517	17/05/2011	C	989,63
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861AD9	SAB/PAG 20110208	08/02/2011	C	996,20
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861FH9	SAB/PAG 20110131	31/01/2011	C	997,21
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861FI7	SAB/PAG 20110215	15/02/2011	C	996,89
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861FJ5	SAB/PAG 20110323	23/03/2011	C	992,75
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861FK3	SAB/PAG 20110330	30/03/2011	C	992,55
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861GJ3	SAB/PAG 20110111	11/01/2011	C	998,86
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861GM7	SAB/PAG 20110620	20/06/2011	C	987,35
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861HS2	SAB/PAG 20111104	04/11/2011	C	976,74
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861HY0	SAB/PAG 20110509	09/05/2011	C	990,65
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861IL5	SAB/PAG 20110518	18/05/2011	C	990,21
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861Y02	SAB/PAG 20110202	02/02/2011	C	996,64
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139805F5	BVA/PAG 20110225	25/02/2011	C	996,40
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139805H1	BVA/PAG 20110310	10/03/2011	C	997,25
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139805I9	BVA/PAG 20110325	25/03/2011	C	996,67
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580W61	GUI/PAG 20111103	03/11/2011	C	97.034,62
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580W87	GUI/PAG 20111110	10/11/2011	C	97.027,09
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580X11	GUI/PAG 20111117	17/11/2011	C	97.028,97
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513783L85	PAS/PAG 20110303	03/03/2011	C	996,40
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513783Q80	PAS/PAG 20110215	15/02/2011	C	997,78
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES05138062C1	POP/PAG 20110603	03/06/2011	C	990,13
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES05138064N4	POP/PAG 20110105	05/01/2011	C	997,23
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES05138064Y1	POP/PAG 20110325	25/03/2011	C	993,30
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES05138064Z8	POP/PAG 20110406	06/04/2011	C	992,17
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES05138065T8	POP/PAG 20110510	10/05/2011	C	990,95
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806663	POP/PAG 20110114	14/01/2011	C	997,35
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES05138066C2	POP/PAG 20111118	18/11/2011	C	973,52
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES05138066F5	POP/PAG 20110221	21/02/2011	C	997,71
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806911	POP/PAG 20110218	18/02/2011	C	995,91
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135402M1	BBE/PAG 20110211	11/02/2011	C	995,22
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135402N9	BBE/PAG 20110218	18/02/2011	C	996,36
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135402V2	BBE/PAG 20110331	31/03/2011	C	991,79
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135402X8	BBE/PAG 20110429	29/04/2011	C	993,34
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135403F3	BBE/PAG 20110712	12/07/2011	C	986,57
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135403K3	BBE/PAG 20110221	21/02/2011	C	997,58
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135403V0	BBE/PAG 20110408	08/04/2011	C	991,53
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135403W8	BBE/PAG 20110420	20/04/2011	C	990,37
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135403Y4	BBE/PAG 20110510	10/05/2011	C	990,67
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135403Z1	BBE/PAG 20111122	22/11/2011	C	976,82
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135404A2	BBE/PAG 20110201	01/02/2011	C	997,25
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135404B0	BBE/PAG 20110302	02/03/2011	C	995,91
BANKINTER, S.A.	ES0513679PD3	BKT/PAG 20110411	11/04/2011	C	991,98
BANKINTER, S.A.	ES0513679PF8	BKT/PAG 20110202	02/02/2011	C	996,94
BANKINTER, S.A.	ES0513679PH4	BKT/PAG 20110218	18/02/2011	C	996,14
BANKINTER, S.A.	ES0513679PI2	BKT/PAG 20110301	01/03/2011	C	995,46
BANKINTER, S.A.	ES0513679PJ0	BKT/PAG 20110324	24/03/2011	C	991,94
BANKINTER, S.A.	ES0513679PN2	BKT/PAG 20110503	03/05/2011	C	990,82
BANKINTER, S.A.	ES0513679PX1	BKT/PAG 20110620	20/06/2011	C	988,32
BANKINTER, S.A.	ES0513679PY9	BKT/PAG 20110107	07/01/2011	C	997,61
BANKINTER, S.A.	ES0513679PZ6	BKT/PAG 20110310	10/03/2011	C	994,26
BANKINTER, S.A.	ES0513679QC3	BKT/PAG 20110408	08/04/2011	C	993,36
BANKINTER, S.A.	ES0513679QD1	BKT/PAG 20110822	22/08/2011	C	982,53
BANKINTER, S.A.	ES0513679QE9	BKT/PAG 20110729	29/07/2011	C	984,87
BANKINTER, S.A.	ES0513679QG4	BKT/PAG 20110127	27/01/2011	C	997,89
BANKINTER, S.A.	ES0513679QK6	BKT/PAG 20110128	28/01/2011	C	997,96
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134245D4	BBK.EMPTOS/PAG 20110114	14/01/2011	C	997,26
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134245N3	BBK.EMPTOS/PAG 20110303	03/03/2011	C	996,75
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134245R4	BBK.EMPTOS/PAG 20110810	10/08/2011	C	986,30
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134245U8	BBK.EMPTOS/PAG 20110201	01/02/2011	C	996,68
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687QG7	BBVAF/PAG 20110103	03/01/2011	C	999,86
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687QI3	BBVAF/PAG 20111223	23/12/2011	C	979,42
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687QL7	BBVAF/PAG 20110127	27/01/2011	C	998,44
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA, TARRAGONA I MANR	ES0518538212	CATALUNYA.CAIXA/PAG 20111013	13/10/2011	C	48.535,83
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149664S7	CA.PENEDES/PAG 20110406	06/04/2011	C	988,79
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0514826310	CAJASTUR/PAG 20110218	18/02/2011	C	49.827,21
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES05148263X9	CAJASTUR/PAG 20110331	31/03/2011	C	49.603,76
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES05148263Y7	CAJASTUR/PAG 20110415	15/04/2011	C	49.577,44
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES05148264A5	CAJASTUR/PAG 20110506	06/05/2011	C	49.561,38
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES05148264B3	CAJASTUR/PAG 20110513	13/05/2011	C	49.532,95
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICAN	ES0514977M62	BANCAJA/PAG 20110225	25/02/2011	C	996,23
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153084H4	CA.VITAL/PAG 20110526	26/05/2011	C	49.493,02
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153084J0	CA.VITAL/PAG 20110316	16/03/2011	C	49.679,75
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153084O0	CA.VITAL/PAG 20110228	28/02/2011	C	49.736,39
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153084U7	CA.VITAL/PAG 20110401	01/04/2011	C	49.579,24
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153084V5	CA.VITAL/PAG 20110315	15/03/2011	C	49.568,14
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153084W3	CA.VITAL/PAG 20110413	13/04/2011	C	49.494,08

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153084X1	CA.VITAL/PAG 20110513	13/05/2011	C	49.403,59
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153084Y9	CA.VITAL/PAG 20110301	01/03/2011	C	49.712,44
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153084Z6	CA.VITAL/PAG 20111028	28/10/2011	C	48.797,59
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153085C2	CA.VITAL/PAG 20110810	10/08/2011	C	49.196,73
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0514400B05	CAM/PAG 20110210	10/02/2011	C	993,27
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMAD	ES05149872H9	CA.EXTREM/PAG 20110415	15/04/2011	C	24.823,49
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMAD	ES05149872I7	CA.EXTREM/PAG 20110812	12/08/2011	C	24.589,86
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA	ES05153090B4	KUTXA/PAG 20111216	16/12/2011	C	98.039,22
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA	ES0515309732	KUTXA/PAG 20110408	08/04/2011	C	99.053,93
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA	ES0515309856	KUTXA/PAG 20110128	28/01/2011	C	99.456,35
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA	ES0515309948	KUTXA/PAG 20110329	29/03/2011	C	99.126,43
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA	ES0515309955	KUTXA/PAG 20110930	30/09/2011	C	97.667,28
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA	ES0515309963	KUTXA/PAG 20111010	10/10/2011	C	97.670,13
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA	ES0515309989	KUTXA/PAG 20110421	21/04/2011	C	99.041,79
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA	ES0515309997	KUTXA/PAG 20110805	05/08/2011	C	98.429,69
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950D19	CA.MADRID/PAG 20110330	30/03/2011	C	992,96
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950D19	CA.MADRID/PAG 20110203	03/02/2011	C	996,76
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES05149542P1	IBERCAJA/PAG 20110303	03/03/2011	C	993,19
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES05149542X5	IBERCAJA/PAG 20110407	07/04/2011	C	992,45
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES05149542Z0	IBERCAJA/PAG 20110428	28/04/2011	C	990,77
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES05149543A1	IBERCAJA/PAG 20110901	01/09/2011	C	982,65
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES05149543B9	IBERCAJA/PAG 20110811	11/08/2011	C	982,31
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES05149543C7	IBERCAJA/PAG 20110519	19/05/2011	C	990,60
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970QF8	LACAIXA/PAG 20110215	15/02/2011	C	996,19
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA DE	ES0515306I26	CR.NAVARRA/PAG 20111102	02/11/2011	C	48.819,31
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870344	GAS/PAG 20110204	04/02/2011	C	997,45
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870427	GAS/PAG 20110405	05/04/2011	C	992,43
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870476	GAS/PAG 20120405	05/04/2012	C	965,37
LICO LEASING, S.A., E.F.C.	ES05176176C2	LICO.LEASING/PAG 20110509	09/05/2011	C	98.888,09
LICO LEASING, S.A., E.F.C.	ES05176176D0	LICO.LEASING/PAG 20110623	23/06/2011	C	98.880,78
M.P. Y C.A. RONDA, CÁDIZ, ALMERIA, MÁLAGA, ANTEQUE	ES0558759066	UNICAJA/PAG 20110120	20/01/2011	C	49.840,36
M.P. Y C.A. RONDA, CÁDIZ, ALMERIA, MÁLAGA, ANTEQUE	ES0558759082	UNICAJA/PAG 20110221	21/02/2011	C	49.822,85
M.P. Y C.A. SAN FERNANDO DE GUADALAJARA, HUELVA,	ES05581971V5	CAJASOL/PAG 20110407	07/04/2011	C	992,77
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495C11	SAN.CONS.FIN/PAG 20110211	11/02/2011	C	994,24
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CL5	SAN.CONS.FIN/PAG 20110311	11/03/2011	C	994,20
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495DM1	SAN.CONS.FIN/PAG 20110128	28/01/2011	C	997,09
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495DU4	SAN.CONS.FIN/PAG 20110318	18/03/2011	C	996,59
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495FA1	SAN.CONS.FIN/PAG 20120831	31/08/2012	C	963,28
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495FC7	SAN.CONS.FIN/PAG 20120907	07/09/2012	C	962,91
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495FJ2	SAN.CONS.FIN/PAG 20111021	21/10/2011	C	980,18
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495FL8	SAN.CONS.FIN/PAG 20121207	07/12/2012	C	952,91

PARTICIPACIONES PREFERENTES

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCAJA EUROCAPITAL FINANCE, S.A.	KYG0727Q1073	BANCAJA.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	600,00
BANCAJA EUROCAPITAL FINANCE, S.A.	KYG0727Q1156	BANCAJA.FIN/VAR NACU AMTB PPR B		V	599,99
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0113860003	SAB/VAR NACU AMTB PPR		V	1.008,36
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0113440004	BTO/VAR NACU AMTB PPR 1		V	1.000,00
BANKINTER EMISIONES, S.A.U.	ES0113549002	BKT.EM/VAR NACU AMTB PPR I		V	37,83
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224001	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	100,32
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224027	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR B		V	100,11
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224043	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR C		V	100,11
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224050	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR D		V	100,79
BBVA INTERNATIONAL LIMITED	KYG090001119	BBVA.INTL/VAR NACU AMTB PPR F		V	100,11
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL LTD.	KYG1280W1015	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.008,20
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL LTD.	KYG717151099	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.008,08
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL LTD.	KYG717151172	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.008,48
BVA PREFERENTES, S.A.U.	ES0115006001	BVA.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	26.957,70
CAIXA CATALUNYA PREFERENTS, S.A.U.	KYG175431025	CA.CAT.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.001,18
CAIXA CATALUNYA PREFERENTS, S.A.U.	KYG175431108	CA.CAT.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.001,17
CAIXA DE MANLLEU PREFERENTS, S.A.	ES0115328009	CA.MANLLEU.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	500,73
CAIXA GALICIA PREFERENTS, S.A.	ES0112805009	CA.GALICIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	591,44
CAIXA GALICIA PREFERENTS, S.A.	ES0112805025	CA.GALICIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR D		V	1.005,27
CAIXA GALICIA PREFERENTS, S.A.	ES0112805041	CA.GALICIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR E		V	1.011,51
CAIXA LAIETANA, SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFE	ES0113251005	LAIETANA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	44.711,20
CAIXA LAIETANA, SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFE	ES0113251021	LAIETANA.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.009,45
CAIXA LAIETANA, SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFE	KYG1754W1087	LAIETANA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.004,82
CAIXA MANRESA PREFERENTS, S.A.	ES0115211007	CA.MANRESA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	100,07
CAIXA ONTINYENT PREFERENTS, S.A.U.	ES0157083025	ONTINYENT.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	50.000,00
CAIXA PENEDES CAPITAL, S.A.	ES0158672008	CA.PENEDES.CAP/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.007,19
CAIXA PENEDES CAPITAL, S.A.	KYG1755N1079	CA.PENEDES.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.003,66
CAIXA PREFERENCE, S.A.	KYG175471039	CAIXA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.003,64
CAIXA PREFERENCE, S.A.	KYG175471112	CAIXA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.003,02
CAIXA TERRASSA, SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFE	KYG175491094	TERRASSA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.002,93
CAIXANOVA EMISIONES, S.A.U.	ES0169075001	CAIXANOVA.EM/VAR NACU AMTB PPR A		V	60,10
CAIXANOVA EMISIONES, S.A.U.	ES0169075050	CAIXANOVA.EM/VAR NACU AMTB PPR D		V	100,82
CAIXASABADELL PREFERENTS, S.A.U.	ES0101339002	CAIXASAB.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.003,70
CAIXASABADELL PREFERENTS, S.A.U.	ES0101339028	CAIXASAB.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	36.366,21

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0114965009	CAN/VAR NACU AMTB PPR		V	1.006,73
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0114959002	CA.SEGOVIA/VAR NACU AMTB PPR		V	1.002,58
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA	ES0114954003	IBERCAJA/VAR NACU AMTB PPR 1ª		V	30.060,70
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0114970009	LACAIXA/VAR NACU AMTB PPR I		V	1.007,99
CAJA DE AVILA PREFERENTES, S.A.U.	ES0122707005	CA.AVILA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.005,18
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA,	ES0114854005	CAJADUERO/VAR NACU AMTB PPR		V	100,34
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANCA Y SORIA,	ES0115474001	CA.ESPAÑA/VAR NACU AMTB PPR I		V	1.028,18
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SDAD DE PART. PREF.,	ES0115372007	CA.ESPAÑA.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.003,48
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0115009005	CAJACANARIAS/VAR NACU AMTB PPR		V	1.014,84
CAJA MADRID FINANCE PREFERRED, S.A.	ES0115373005	CA.MAD.FIN.PREF/VAR NACU AMTB PPR I		V	93,49
CAJA MADRID FINANCE PREFERRED, S.A.	ES0115373021	CA.MAD.FIN.PREF/VAR NACU AMTB PPR 2		V	102,69
CAJA RIOJA PREFERENTES, S.A.	ES0113698007	CA.RIOJA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	501,32
CAJAGRANADA PREFERENTES, S.A.U.	ES0158952004	CAGRANADA.PREF./VAR NACU AMTB PPR A		V	100,71
CAJAMURCIA FINANCE, S.A.	KYG175552051	CAJAMURCIA.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	502,48
CAJAMURCIA PREFERENTES, S.A.U.	ES0114818000	CAJAMURCIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	504,84
CAJAMURCIA PREFERENTES, S.A.U.	ES0114818059	CAJAMURCIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR E		V	503,20
CAJASOL PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.	KYG1755U1195	CAJASOL.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	300,75
CAJASUR, SOCIEDAD DE PARTICIPACIONES PREFERENT	KYG1755M1096	CAJASUR.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	600,00
CAM CAPITAL, S.A., SOCIEDAD UNIPERSONAL	ES0114607007	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.009,43
CAM CAPITAL, S.A., SOCIEDAD UNIPERSONAL	KYG1793R1020	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	600,94
CAM CAPITAL, S.A., SOCIEDAD UNIPERSONAL	KYG1793R1103	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR B		V	600,95
CANTABRIA CAPITAL SOCIEDAD DE PARTICIPACIONES P	KYG1825G1082	CANTABRIA.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	600,95
CANTABRIA PREFERENTES, S.A.	ES0182834004	CANTABRIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR I		V	1.001,22
CANTABRIA PREFERENTES, S.A.	ES0182834020	CANTABRIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR 2		V	1.001,15
CANTABRIA PREFERENTES, S.A.	ES0182834046	CANTABRIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR 3		V	1.009,53
EL MONTE CAPITAL, S.A.U.	KYG3014M1024	MONTE.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	500,81
EL MONTE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.	ES0128469006	EL.MONTE.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.001,93
EL MONTE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.	ES0128469022	EL.MONTE.PREF/VAR NACU AMTB PPR D		V	504,66
ENDESA CAPITAL FINANCE, L.L.C.	USU291871080	ELE.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR		V	22,09
GUIPUZCOANO CAPITAL, S.A.	ES0143561001	GUI.CAP/VAR NACU AMTB PPR I		V	34,03
GUIPUZCOANO CAPITAL, S.A.	ES0143561043	GUI.CAP/VAR NACU AMTB PPR III		V	100,00
LA CAJA DE CANARIAS PREFERENTES, S.A.	ES0156844005	LA.CAJA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	502,83
LA CAJA DE CANARIAS PREFERENTES, S.A.	ES0156844054	LA.CAJA.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	505,54
PASTOR PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.U.	ES0168569004	PASTOR.PREF/VAR NACU AMTB PPR 1		V	100,00
POPULAR CAPITAL, S.A.	ES0170412003	POP.CAP./VAR NACU AMTB PPR D		V	100,08
REPSOL INTERNATIONAL CAPITAL LTD.	KYG7513K1379	REP.INTL.CAP/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.005,01
REPSOL INTERNATIONAL CAPITAL LTD.	KYG7513K1452	REP.INTL.CAP/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.005,13
SA NOSTRA DE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.U	KYG7803W1069	SA.NOSTRA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.001,07
SABADELL INTERNATIONAL EQUITY, LTD	KYG773751063	SAB.INTL.EQ/VAR NACU AMTB PPR A		V	501,09
SANTANDER FINANCE CAPITAL, S.A.U.	ES0175179078	SAN.FIN.CAP/VAR NACU AMTB PPR X		V	21,51
SOL MELIA FINANCE LIMITED	KYG8259W1033	SOL.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	79,84
SOS CORPORACION ALIMENTARIA PREFERENTES, S.A.U	ES0130124003	SOS.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	27.000,68
TELEFONICA FINANCE USA, L.L.C.	USU87942AA33	TEF.FIN.USA/VAR NACU AMTB PPR		V	1.005,23
UNION FENOSA FINANCIAL SERVICES USA, L.L.C.	USU90716AA64	UNF.FINL.USA/VAR NACU AMTB PPR		V	20,91

RENTA VARIABLE

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
AB-BIOTICS, S.A.	ES0109659013	AB-BIOTICS/AC 0,05			3,20
ABENGOA, S.A.	ES0105200416	ABG/AC 0,25			18,56
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0111845014	ABE/AC 3,00			13,55
ACCIONA, S.A.	ES0125220311	ANA/AC 1,00			57,97
ACERINOX, S.A.	ES0132105018	ACX/AC 0,25			12,18
ACS, ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS, S.	ES0167050915	ACS/AC 0,50			36,27
ADOLFO DOMINGUEZ, S.A.	ES0106000013	ADZ/AC 0,60			9,16
AGUAS DE SABADELL, CIA., S.A.	ES0107350011	AGUAS.SAB/AC B 12,02			65,77
AHORRO FAMILIAR, S.A.	ES0107511018	AH.FAMILIAR/AC 6,00			25,17
ALFA, S.A.B. DE C.V.	MXP000511016	AC. ALFA S/A			63,25
ALMIRALL, S.A.	ES0157097017	ALM/AC 0,12			7,22
ALTIA CONSULTORES, S.A.	ES0113312005	ALTIA.CONSULT/AC 0,02			2,87
ALZA REAL ESTATE, S.A.	ES0138436011	ALZA/AC 1,00			4,39
AMADEUS IT HOLDING, S.A.	ES0109067019	AMS/AC A 0,001			14,61
AMERICA MOVIL, S.A.B. DE C.V.	MXP001691213	AC. AMERICA MOVIL. S/L			41,57
AMPER, S.A.	ES0109260531	AMP/AC 1,00			3,47
ANTENA 3 DE TELEVISION, S.A.	ES0109427734	A3TV/AC 0,75			6,85
ARCELORMITTAL, S.A.	LU0323134006	ARCELORMITTAL/AC SVN			25,61
AYCO GRUPO INMOBILIARIO, S.A.	ES0152960011	AYCO.GRP.INMO/AC 3,01			9,80
AZKOYEN, S.A.	ES0112458312	AZK/AC 0,60			2,25
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0113211835	BBVA/AC 0,49			8,58
BANCO BRADESCO, S.A.	BRBBDACACNPR8	AC. BANCO BRADESCO -PREF.-			14,96
BANCO DE CHILE, S.A.	CLP0939W1081	AC. BANCO DE CHILE			64,37
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0113860A34	SAB/AC 0,125			3,31
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0113980F34	BVA/AC 0,25			3,72
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0113440038	BTO/AC 0,79			6,78
BANCO PASTOR, S.A.	ES0113770434	PAS/AC 0,33			3,58
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0113790531	POP/AC 0,10			4,31
BANCO SANTANDER RIO, S.A.	ARBRI0010194	AC. BCO SANTANDER RIO. S/B			1,86
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0113900J37	SAN/AC 0,50			8,62
BANKINTER, S.A.	ES0113679137	BKT/AC 0,30			4,55

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BARON DE LEY, S.A.	ES0114297015	BDL/AC 0,60			43,66
BAYER A.G.	DE000BAY0017	AC. BAYER			55,66
BBVA BANCO FRANCÉS, S.A.	ARP125991090	AC. BBVA BCO. FRANCÉS			2,72
BEFESA MEDIO AMBIENTE, S.A.	ES0114491014	BMA/AC 3,01			16,70
BIOSEARCH, S.A.	ES0172233118	BIO/AC 0,24			0,70
BODACLICK, S.A.	ES0171957014	BODACLICK/AC 0,02			2,68
BODEGAS BILBAINAS, S.A.	ES0114930011	BODEGAS.BILB/AC 6,01			8,65
BODEGAS RIOJANAS, S.A.	ES0115002018	RIO/AC 0,75			7,02
BOLSAS Y MERCADOS ESPAÑOLES, SDAD HOLDING DE	ES0115056139	BME/AC 3,23			19,05
BRADSPAR, S.A.	BRBRAPACNOR5	AC. BRADSPAR			18,12
BRADSPAR, S.A.	BRBRAPACNPR2	AC. BRADSPAR -PREF.-			18,91
BRASKEM, S.A.	BRBRKMACNPA4	AC. BRASKEM -PREF.-			7,88
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0114400007	CAM/CUPART 2,00			7,00
CAMPOFRIO FOOD GROUP, S.A.	ES0121501318	CFG/AC 1,00			7,20
CARTERA INDUSTRIAL REA, S.A.	ES0162292017	CART.IND.REA/AC 2,30			2,39
CEMENTOS MOLINS, S.A.	ES0117360117	CEMENTOS.MOLINS/AC 0,30			8,78
CEMENTOS PORTLAND VALDERRIVAS, S.A.	ES0117390411	CPL/AC 1,50			13,62
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNOR6	AC. ELETROBRAS			9,92
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNBP7	AC. ELETROBRAS. PREF. S/B			11,78
CIE AUTOMOTIVE, S.A.	ES0105630315	CIE/AC 0,25			4,04
CLINICA BAVIERA, S.A.	ES0119037010	CBAV/AC 0,10			7,44
CODERE, S.A.	ES0119256115	CDR/AC 0,20			8,11
COMPANHIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	BRCMIGACNPR3	AC. CEMIG -PREF.-			12,45
COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	BRCPLEACNBP9	AC. COPEL -PREF.-			17,91
CONSTRUCCIONES Y AUXILIAR DE FERROCARRILES, S.A.	ES0121975017	CAF/AC 3,01			386,76
CORPORACION DERMOESTETICA, S.A.	ES0124204019	DERM/AC 0,10			1,69
CORPORACION FINANCIERA ALBA, S.A.	ES0117160111	ALB/AC 1,00			37,05
CORPORACION GEO, S.A.B. DE C.V.	MXP3142C1177	AC. GEO. S/B			2,41
CRITERIA CAIXACORP, S.A.	ES0140609019	CRI/AC 1,00			3,97
DESARROLLOS ESPECIALES DE SISTEMAS DE ANCLAJE	ES0126251018	DESA/AC 0,50			11,88
DINAMIA CAPITAL PRIVADO, SCR, S.A.	ES0126501131	DIN/AC 3,00			8,70
DURO FELGUERA, S.A.	ES0162600417	MDF/AC 0,50			5,71
EBRO FOODS, S.A.	ES0112501012	EBRO/AC 0,60			15,49
ELECNOR, S.A.	ES0129743318	ENO/AC 0,10			9,76
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD, S.A.	CLP3710M1090	AC. ENDESA CHILE			40,83
ENAGAS, S.A.	ES0130960018	ENG/AC 1,50			15,07
ENDESA, S.A.	ES0130670112	ELE/AC 1,20			19,18
ENEL GREEN POWER, S.P.A.	IT0004618465	EGPW/AC 0,20			1,57
ENERSIS, S.A.	CLP371861061	AC. ENERSIS			17,40
ERCROS, S.A.	ES0125140A14	ECR/AC 0,30			0,76
ESPAÑOLA DE PETROLEOS, CIA., S.A.	ES0132580319	CEP/AC 1,00			17,96
ESPAÑOLA DE VIVIENDAS EN ALQUILER, CIA., S.A.	ES0132955016	CEVASA/AC 6,00			153,85
EURONA WIRELESS TELECOM, S.A.	ES0133443004	EURONA.WIRELESS/AC 1,00			1,25
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE AND SPACE COMPAN	NL0000235190	AC. EADS			18,01
FAES FARMA, S.A.	ES0134950F36	FAE/AC 0,10			2,85
FERGO AISA, S.A.	ES0106585013	AISA/AC 1,00			0,36
FERROVIAL, S.A.	ES0118900010	FER/AC 0,20			7,79
FERSA ENERGIAS RENOVABLES, S.A.	ES0136463017	FRS/AC 1,00			1,14
FINANZAS E INVERSIONES VALENCIANAS, S.A.	ES0138152113	F&I.VALENCIANAS/AC 1,00			72,45
FLUIDRA, S.A.	ES0137650018	FDR/AC 1,00			2,50
FOMENTO DE CONSTRUCCIONES Y CONTRATAS, S.A.	ES0122060314	FCC/AC 1,00			19,33
FUNESPAÑA, S.A.	ES0140441017	FUN/AC 0,30			6,63
GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA, S.A.	ES0143416115	GAM/AC 0,17			5,22
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0116870314	GAS/AC 1,00			10,89
GENERAL DE ALQUILER DE MAQUINARIA, S.A.	ES0141571119	GALQ/AC 1,00			1,73
GERDAU, S.A.	BRGGBRACNPR8	AC. GERDAU -PREF.-			9,54
GESTVISION TELECINCO, S.A.	ES0152503035	TL5/AC 0,50			8,60
GRIFOLS, S.A.	ES0171996012	GRF/AC 0,50			10,37
GRUPO CATALANA OCCIDENTE, S.A.	ES0116920333	GCO/AC 0,30			13,35
GRUPO ELEKTRA, S.A. DE C.V.	MX01EL000003	AC. GRUPO ELEKTRA			28,96
GRUPO EMPRESARIAL ENCE, S.A.	ES0130625512	ENC/AC 0,90			2,45
GRUPO EMPRESARIAL SAN JOSE, S.A.	ES0180918015	GSJ/AC 0,03			5,25
GRUPO EZENTIS, S.A.	ES0172708317	EZE/AC 0,50			0,52
GRUPO FINANCIERO BANORTE S.A.B. DE C.V.	MXP370711014	AC. BANORTE S/O			32,00
GRUPO MODELO, S.A.B. DE C.V.	MXP4833F1044	AC. GRUPO MODELO. S/C			42,41
GRUPO NOSTRUM RNL, S.A.	ES0162603007	GRUPO.NOSTRUM/AC 1,00			4,70
GRUPO TAVEX, S.A.	ES0108180219	TVX/AC 0,92			0,43
HULLERA VASCO-LEONESA, S.A., SDAD.	ES0146940012	HULLERA.VAS-LE/AC 3,01			3,06
IBERDROLA RENOVABLES, S.A.	ES0147645016	IBR/AC 0,50			2,45
IBERDROLA, S.A.	ES0144580Y14	IBE/AC 0,75			5,73
IBERIA LINEAS AEREAS DE ESPAÑA, S.A.	ES0147200036	IBLA/AC 0,78			3,18
IBERPAPEL GESTION, S.A.	ES0147561015	IBG/AC 0,60			13,50
IMAGINARIUM, S.A.	ES0147791018	IMAGINARIUM/AC 0,03			2,34
INDRA SISTEMAS, S.A.	ES0118594417	IDR/AC A 0,20			13,40
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL, S.A.	ES0148396015	ITX/AC 0,15			58,90
INMOBILIARIA COLONIAL, S.A.	ES0139140018	COL/AC 0,12			0,07
INMOBILIARIA DEL SUR, S.A.	ES0154653911	ISUR/AC 2,00			13,76
INMOLEVANTE, S.A.	ES0154949012	INMOLEVANTE/AC 3,00			11,00
INVERFIATC, S.A.	ES0143419317	INVERFIATC/AC 1,00			0,74
INVERSIONES MOBILIARIAS BARCINO, S.A.	ES0155972237	INV.MOB.BARCINO/AC 1,00			1,10
INYPSA INFORMES Y PROYECTOS, S.A.	ES0152768612	INY/AC 0,50			1,78
JAZZTEL, PLC.	GB00B5TMSPP1	JAZ/AC 0,80			3,32
LABORATORIOS FARMACEUTICOS ROVI, S.A.	ES0157261019	ROVI/AC 0,06			5,01
LET'S GOWEX, S.A.	ES0158252017	LET'S.GOWEX/AC 0,05			3,41

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
LEVANTINA DE EDIFICACION Y OBRAS PUBLICAS, CIA, S.	ES0158300410	CLEO/AC 1,00			8,18
LIBERTAS 7, S.A.	ES0137998A12	LIBERTAS.7/AC 0,50			12,06
LINGOTES ESPECIALES, S.A.	ES0158480311	LGT/AC 1,00			3,39
LIWE ESPAÑOLA, S.A.	ES0158545030	LIWE.ESPAÑOLA/AC 3,15			5,30
LOGISTICA DE HIDROCARBUROS CLH, CIA., S.A.	ES0110480219	CLH/AC D 1,20			32,66
MAPFRE, S.A.	ES0124244E34	MAP/AC 0,10			2,20
MEDCOM TECH, S.A.	ES0161857018	MEDCOM.TECH/AC 0,01			3,26
METROVACESA, S.A.	ES0154220414	MVC/AC 1,50			6,83
MIQUEL Y COSTAS & MIQUEL, S.A.	ES0164180012	MCM/AC 2,00			20,60
MONTEBALITO, S.A.	ES0116494016	MTB/AC 1,00			2,24
NACIONAL FINANCIERA, S.N.C.	MX1BNA060006	NAFINSA/CERT NAFTRAC 2002			15,28
NATRA, S.A.	ES0165515117	NAT/AC 1,20			2,05
NATRACEUTICAL, S.A.	ES0165359011	NTC/AC 0,10			0,36
NEGOCIO & ESTILO DE VIDA, S.A.	ES0165946015	NEGOCIO.ESTILO/AC 0,01			3,70
NET SERVIÇOS DE COMUNICAÇÃO, S.A.	BRNETCACNPR3	AC. NET SERVIÇOS DE COMUNICAÇÃO -PR			9,85
NEURON BIOPHARMA, S.A.	ES0166198012	NEURON.BIOPH./AC 1,00			2,71
NH HOTELES, S.A.	ES0161560018	NHH/AC 2,00			3,39
NICOLAS CORREA, S.A.	ES0166300212	NEA/AC 0,80			1,36
NYESA VALORES CORPORACION, S.A.	ES0150480111	NYE/AC 1,20			1,82
OBRASCON HUARTE LAIN, S.A.	ES0142090317	OHL/AC 0,60			22,78
PAPELES Y CARTONES DE EUROPA, S.A.	ES0168561019	PAC/AC 2,00			3,59
PESCANOVA, S.A.	ES0169350016	PVA/AC 6,00			23,85
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNOR9	AC. PETROBRAS			12,43
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNPR6	AC. PETROBRAS -PREF.-			11,29
PRIM, S.A.	ES0170884417	PRM/AC 0,25			5,57
PROMOTORA DE INFORMACIONES, S.A.	ES0171743042	PRS/ACSVT CONV B 0,10			1,38
PROMOTORA DE INFORMACIONES, S.A.	ES0171743117	PRS/AC A 0,10			1,73
PROSEGUR, CIA. DE SEGURIDAD, S.A.	ES0175438235	PSG/AC 0,60			43,87
QUABIT INMOBILIARIA, S.A.	ES0110944016	QBT/AC 0,20			0,12
REALIA BUSINESS, S.A.	ES0173908015	RLIA/AC 0,24			1,55
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0173093115	REE/AC 2,00			35,57
RENO DE MEDICI, S.P.A.	IT0001178299	AC. RENO DE MEDICI. S/A			0,25
RENTA 4 SERVICIOS DE INVERSION, S.A.	ES0173358039	R4/AC 0,40			4,95
RENTA CORPORACION REAL ESTATE, S.A.	ES0173365018	REN/AC 1,00			1,70
REPSOL YPF, S.A.	ES0173516115	REP/AC 1,00			20,02
REYAL URBIS, S.A.	ES0122761010	REY/AC 0,01			1,33
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES0182870214	SYV/AC 1,00			4,62
SARE, S.A.B., DE C.V.	MX01SA030007	AC. SARE. S/B			2,04
SEDA DE BARCELONA, LA, S.A.	ES0175290115	SED/AC 0,10			0,06
SERVICE POINT SOLUTIONS, S.A.	ES0143421G11	SPS/AC 0,60			0,49
SNIACE, S.A.	ES0165380017	SNC/AC 0,10			1,07
SOCIEDAD ANONIMA DAMM	ES0125690513	DAMM/AC 0,20			6,56
SOL MELIA, S.A.	ES0176252718	SOL/AC 0,20			6,72
SOLARIA ENERGIA Y MEDIO AMBIENTE, S.A.	ES0165386014	SLR/AC 0,01			1,47
SOS CORPORACION ALIMENTARIA, S.A.	ES0110047919	SOS/AC 0,50			1,13
SOTOGRADE, S.A.	ES0138109014	STG/AC 0,60			2,47
TECNICAS REUNIDAS, S.A.	ES0178165017	TRE/AC 0,10			44,19
TECNOCOM, TELECOMUNICACIONES Y ENERGIA, S.A.	ES0147582B12	TEC/AC 0,50			2,49
TELEFONICA, S.A.	ES0178430E18	TEF/AC 1,00			18,11
TELEFONOS DE MEXICO, S.A.B. DE C.V.	MXP904131325	AC. TELMEX. S/L			11,43
TESTA INMUEBLES EN RENTA, S.A.	ES0170885018	TST/AC 6,00			6,13
TUBACEX, S.A.	ES0132945017	TUB/AC 0,45			2,41
TUBOS REUNIDOS, S.A.	ES0180850416	TRG/AC 0,10			1,86
TV AZTECA, S.A. DE C.V.	MXP740471117	AC. TV AZTECA			5,33
UNION EUROPEA DE INVERSIONES, S.A.	ES0181480114	U.EUROPEA.INV/AC 1,00			10,16
UNIPAPEL, S.A.	ES0182045312	UPL/AC 1,50			10,53
URALITA, S.A.	ES0182170615	URA/AC 0,72			3,77
URBAR INGENIEROS, S.A.	ES0182484214	URBAR.ING/AC 0,50			4,38
URBAS GUADAHERMOSA, S.A.	ES0182280018	URBAS/AC 0,10			0,06
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNOR3	AC. USIMINAS			10,30
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNPA6	AC. USIMINAS -PREF.-			8,92
VALE, S.A.	BRVALEACNOR0	AC. VALE			23,96
VALE, S.A.	BRVALEACNPA3	AC. VALE. PREF. 6%			22,54
VERTICE TRESIENTOS SESENTA GRADOS, S.A.	ES0183304312	VER/AC 0,50			0,22
VIDRALA, S.A.	ES0183746314	VID/AC 1,02			20,49
VINICOLA DEL NORTE DE ESPAÑA, S.A., CIA.	ES0184140210	CUN/AC 0,24			13,70
VISCOFAN, S.A.	ES0184262212	VIS/AC 0,30			25,95
VOCENTO, S.A.	ES0114820113	VOC/AC 0,20			3,64
VOLCAN COMPAÑIA MINERA, S.A.A.	PEP648014202	AC. VOLCAN. PREF. S/B			8,76
VUELING AIRLINES, S.A.	ES0184591032	VLG/AC 1,00			9,53
ZARDOYA OTIS, S.A.	ES0184933812	ZOT/AC 0,10			11,88
ZELTIA, S.A.	ES0184940817	ZEL/AC 0,05			2,99
ZINKIA ENTERTAINMENT, S.A.	ES0184849018	ZNK/AC 0,10			1,10