

esta Dirección General, considerando que esa entidad cumple los requisitos establecidos a tal efecto en el artículo 20.2 del texto refundido de la Ley de regulación de los planes y fondos de pensiones, aprobada por Real Decreto Legislativo 1/2002, de 29 de noviembre, en el artículo 80 del Reglamento ya citado, con esta fecha acuerda:

Proceder a la inscripción de Caixa Tarragona Vida S.A. d'Assegurances y Reassegurances, con CIF A43838895, en el Registro administrativo especial de entidades gestoras de fondos de pensiones, donde queda registrada con la clave operativa G-0218.

Contra la presente resolución, que no agota la vía administrativa, podrá interponerse recurso de alzada ante el Sr. Secretario de Estado de Economía, en el plazo de un mes, de conformidad con lo establecido en los artículos 114 y 115 de la Ley 30/1992, de 26 de noviembre, de Régimen Jurídico de las Administraciones Públicas y del Procedimiento Administrativo Común.

Madrid, 13 de febrero de 2007.—El Director General de Seguros y Fondos de Pensiones, Ricardo Lozano Aragüés.

4125

ORDEN EHA/411/2007, de 20 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 2006, a efectos de la declaración del Impuesto sobre el Patrimonio del año 2006.

Los artículos 13 y 15 de la Ley 19/1991, de 6 de junio, del Impuesto sobre el Patrimonio, establecen que el Ministerio de Economía y Hacienda publicará anualmente 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.

A tal efecto se hace necesario publicar la mencionada información, para lo cual 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 este año la tipología del valor al correspondiente código ISIN y a su denominación y a 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.

Este año se han eliminado los campos que recogían la fecha de emisión, la serie y número de inicio y final de la serie, que se incluían en Ordenes anteriores, al constatarse que no aportaban información de utilidad para el inversor, por lo que complicaban la búsqueda de los valores negociados al ofrecerse a los interesados un exceso de datos no significativos para su correcta identificación.

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 2006; 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 2006, anexas a esta Orden, a efectos de la declaración del Impuesto sobre el Patrimonio del año 2006.

Madrid, 20 de febrero de 2007.—El Vicepresidente Segundo del Gobierno y Ministro de Economía y Hacienda, Pedro Solbes Mira.

LISTADO DEL BOE**ANEXO A LA ORDEN DE****Relación de valores o participaciones con su valor de negociación medio o de liquidación relativa al cuarto trimestre de 2006, a efectos del impuesto sobre el patrimonio de las Personas Físicas, correspondiente al periodo impositivo de 2006.**

Criterio de ordenación:

1º Tipo de renta: Fija y variable, 2º por categoría de valor de acuerdo a las contempladas por la Agencia Nacional de Codificación de Valores (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
COMUNIDAD AUTONOMA DE CANARIAS	ES0000093312	CC.AA.CANA/0,75 BO 20111213	13/12/2011	0.750	100,000
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101289	CC.AA.MAD/VAR OB 20211129	29/11/2021	V	99,962
COMUNIDAD FORAL NAVARRA	ES0001353137	CC.AA.NAV/5,45 OB 20130514	14/05/2013	5.450	108,850
COMUNIDAD FORAL NAVARRA	ES0001353228	CC.AA.NAV/4,00 OB 20211123	23/11/2021	4.000	100,000
DIPUTACION FORAL DE VIZCAYA	ES0201570001	DIPT.VIZCAYA/11,30 OB 20141220	20/12/2014	11.300	150,000
ESTADO	ES0000011470	TESORO/8,20 OBE 20090228	28/02/2009	8.200	109,679
ESTADO	ES0000011595	TESORO/8,70 OBE 20120228	28/02/2012	8.700	123,473
ESTADO	ES0000011629	TESORO/7,35 OBE 20070331	31/03/2007	7.350	101,308
ESTADO	ES0000011652	TESORO/6,00 OBE SEGR 20080131	31/01/2008	6.000	102,650
ESTADO	ES0000011660	TESORO/6,15 OBE SEGR 20130131	31/01/2013	6.150	113,097
ESTADO	ES0000011694	TESORO/CUPCER PPALSEGR 20080131	31/01/2008	C	95,750
ESTADO	ES0000011702	TESORO/CUPCER PPALSEGR 20130131	31/01/2013	C	80,069
ESTADO	ES0000011793	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20070131	31/01/2007	C	99,503
ESTADO	ES0000011801	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20080131	31/01/2008	C	95,648
ESTADO	ES0000011819	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20090131	31/01/2009	C	92,401
ESTADO	ES0000011827	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20100131	31/01/2010	C	88,961
ESTADO	ES0000011835	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20110131	31/01/2011	C	85,582
ESTADO	ES0000011843	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20120131	31/01/2012	C	82,782
ESTADO	ES0000011850	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20130131	31/01/2013	C	79,623
ESTADO	ES0000011868	TESORO/6,00 OBE SEGR 20290131	31/01/2029	6.000	129,779
ESTADO	ES0000011876	TESORO/CUPCER PPALSEGR 20290131	31/01/2029	C	42,132
ESTADO	ES0000011884	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20140131	31/01/2014	C	76,587
ESTADO	ES0000011892	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20150131	31/01/2015	C	73,582
ESTADO	ES0000011900	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20160131	31/01/2016	C	70,516
ESTADO	ES0000011918	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20170131	31/01/2017	C	67,977
ESTADO	ES0000011926	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20180131	31/01/2018	C	65,540
ESTADO	ES0000011934	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20190131	31/01/2019	C	62,570
ESTADO	ES0000011942	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20200131	31/01/2020	C	60,369
ESTADO	ES0000011959	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20210131	31/01/2021	C	57,422
ESTADO	ES0000011967	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20220131	31/01/2022	C	55,085
ESTADO	ES0000011975	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20230131	31/01/2023	C	53,050
ESTADO	ES0000011983	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20240131	31/01/2024	C	50,976
ESTADO	ES0000011991	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20250131	31/01/2025	C	48,786
ESTADO	ES0000012007	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20260131	31/01/2026	C	47,496
ESTADO	ES0000012023	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20270131	31/01/2027	C	45,388
ESTADO	ES0000012031	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20280131	31/01/2028	C	43,732
ESTADO	ES0000012049	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20290131	31/01/2029	C	41,969
ESTADO	ES0000012064	TESORO/5,15 OBE SEGR 20090730	30/07/2009	5.150	103,696
ESTADO	ES0000012098	TESORO/4,75 OBE SEGR 20140730	30/07/2014	4.750	106,881
ESTADO	ES00000120E9	TESORO/3,25 BOEST SEGR 20100730	30/07/2010	3.250	98,418
ESTADO	ES00000120G4	TESORO/3,15 OBE SEGR 20160131	31/01/2016	3.150	95,255
ESTADO	ES00000120H2	TESORO/2,90 BOEST SEGR 20081031	31/10/2008	2.900	98,518
ESTADO	ES00000120I0	TESORO/CUPCER PPALSEGR 20160131	31/01/2016	C	70,503
ESTADO	ES00000120J8	TESORO/3,80 OBE SEGR 20170131	31/01/2017	3.800	99,871
ESTADO	ES00000120K6	TESORO/CUPCER PPALSEGR 20081031	31/10/2008	C	93,181
ESTADO	ES0000012122	TESORO/CUPCER PPALSEGR 20090730	30/07/2009	C	90,692
ESTADO	ES0000012205	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20070730	30/07/2007	C	97,708
ESTADO	ES0000012213	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20080730	30/07/2008	C	94,020
ESTADO	ES0000012221	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20090730	30/07/2009	C	90,944
ESTADO	ES0000012239	TESORO/4,00 OBE SEGR 20100131	31/01/2010	4.000	100,964
ESTADO	ES0000012296	TESORO/CUPCER PPALSEGR 20100131	31/01/2010	C	88,963
ESTADO	ES0000012304	TESORO/CUPCER PPALSEGR 20140730	30/07/2014	C	75,739
ESTADO	ES0000012312	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20100730	30/07/2010	C	87,611
ESTADO	ES0000012320	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20110730	30/07/2011	C	84,269
ESTADO	ES0000012338	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20120730	30/07/2012	C	81,233
ESTADO	ES0000012346	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20130730	30/07/2013	C	78,023
ESTADO	ES0000012353	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20140730	30/07/2014	C	75,334
ESTADO	ES0000012387	TESORO/5,40 OBE SEGR 20110730	30/07/2011	5.400	107,083
ESTADO	ES0000012411	TESORO/5,75 OBE 20320730	30/07/2032	5.750	128,551
ESTADO	ES0000012452	TESORO/5,35 OBE SEGR 20111031	31/10/2011	5.350	107,189
ESTADO	ES0000012510	TESORO/CUPCER PPALSEGR 20111031	31/10/2011	C	83,105
ESTADO	ES0000012585	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20111031	31/10/2011	C	83,502
ESTADO	ES0000012593	TESORO/CUPCER PPALSEGR 20320730	30/07/2032	C	36,375
ESTADO	ES0000012601	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20150730	30/07/2015	C	73,000
ESTADO	ES0000012619	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20160730	30/07/2016	C	70,001
ESTADO	ES0000012627	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20170730	30/07/2017	C	68,000
ESTADO	ES0000012635	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20180730	30/07/2018	C	65,005
ESTADO	ES0000012643	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20190730	30/07/2019	C	62,000
ESTADO	ES0000012650	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20200730	30/07/2020	C	59,859
ESTADO	ES0000012668	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20210730	30/07/2021	C	58,000
ESTADO	ES0000012676	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20220730	30/07/2022	C	55,000
ESTADO	ES0000012684	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20230730	30/07/2023	C	53,000
ESTADO	ES0000012692	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20240730	30/07/2024	C	50,990
ESTADO	ES0000012700	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20250730	30/07/2025	C	49,000

(*) V: Cupón Variable, C: Cupón Cero

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	ES0000012718	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20260730	30/07/2026	C	47,000
ESTADO	ES0000012726	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20270730	30/07/2027	C	45,000
ESTADO	ES0000012734	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20280730	30/07/2028	C	44,000
ESTADO	ES0000012742	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20290730	30/07/2029	C	41,195
ESTADO	ES0000012759	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20300730	30/07/2030	C	40,000
ESTADO	ES0000012767	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20310730	30/07/2031	C	39,000
ESTADO	ES0000012775	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20320730	30/07/2032	C	36,791
ESTADO	ES0000012783	TESORO/5,50 OBE SEGR 20170730	30/07/2017	5.500	114,636
ESTADO	ES0000012791	TESORO/5,00 OBE SEGR 20120730	30/07/2012	5.000	106,306
ESTADO	ES0000012809	TESORO/CUPCER PPALSEGR 20120730	30/07/2012	C	81,075
ESTADO	ES0000012817	TESORO/CUPCER PPALSEGR 20170730	30/07/2017	C	67,242
ESTADO	ES0000012825	TESORO/4,25 OBE SEGR 20071031	31/10/2007	4.250	100,492
ESTADO	ES0000012833	TESORO/CUPCER PPALSEGR 20071031	31/10/2007	C	96,827
ESTADO	ES0000012866	TESORO/4,20 OBE SEGR 20130730	30/07/2013	4.200	102,669
ESTADO	ES0000012882	TESORO/3,60 BOEST SEGR 20090131	31/01/2009	3.600	99,797
ESTADO	ES0000012890	TESORO/CUPCER PPALSEGR 20090131	31/01/2009	C	92,288
ESTADO	ES0000012908	TESORO/3,00 BOEST SEGR 20070730	30/07/2007	3.000	99,539
ESTADO	ES0000012916	TESORO/4,40 OBE SEGR 20150131	31/01/2015	4.400	104,332
ESTADO	ES0000012932	TESORO/4,20 OBE SEGR 20370131	31/01/2037	4.200	104,109
GENERALIDAD VALENCIANA	ES0000105652	GENVAL/6,25 OB 20071215	15/12/2007	6.250	102,549
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095150	GENCAT/8,55 OB 20090131	31/01/2009	8.550	109,646
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095689	GENCAT/4,15 OB 20100203	03/02/2010	4.150	100,910
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095721	GENCAT/5,80 OB 20101130	30/11/2010	5.800	108,949
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095770	GENCAT/5,20 OB 20120930	30/09/2012	5.200	106,600
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095820	GENCAT/3,00 BO 20070716	16/07/2007	3.000	99,354
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095838	GENCAT/4,35 OB 20140716	16/07/2014	4.350	102,885
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095846	GENCAT/3,75 BO 20100215	15/02/2010	3.750	100,046
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095861	GENCAT/3,875 OB 20150915	15/09/2015	3.875	99,377
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095879	GENCAT/4,22 OB 20350426	26/04/2035	4.220	99,618
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095887	GENCAT/3,25 OB 20111130	30/11/2011	3.250	97,626
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095895	GENCAT/4,30 OB 20161115	15/11/2016	4.300	105,147
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000957W5	GENCAT/PAG 20070220	20/02/2007		99,010
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000957X3	GENCAT/PAG 20070306	06/03/2007		98,839
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000958A9	GENCAT/PAG 20070123	23/01/2007		99,337
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000958B7	GENCAT/PAG 20070424	24/04/2007		98,167
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000958C5	GENCAT/PAG 20070206	06/02/2007		99,117
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000958D3	GENCAT/PAG 20070508	08/05/2007		98,183
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000958E1	GENCAT/PAG 20070522	22/05/2007		98,161
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000958G6	GENCAT/PAG 20070410	10/04/2007		98,496
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000958I2	GENCAT/PAG 20070911	11/09/2007		97,134
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000958L6	GENCAT/PAG 20071009	09/10/2007		96,375
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000958N2	GENCAT/PAG 20071023	23/10/2007		96,340
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000958O0	GENCAT/PAG 20071106	06/11/2007		96,305
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000958P7	GENCAT/PAG 20071120	20/11/2007		96,240
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000958Q5	GENCAT/PAG 20070605	05/06/2007		98,164
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000958R3	GENCAT/PAG 20071204	04/12/2007		96,486
GOBIERNO VASCO	ES0000106403	GOB.VASCO/5,55 OB 20071219	19/12/2007	5.550	105,335
INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL	ES0200130278	ICO/6,75 OB 20070102	02/01/2007	6.750	100,140
INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL	ES0200130351	ICO/6,00 OB 20070707	07/07/2007	6.000	101,352

RENTA FIJA
DEUDA EMITIDA POR EL ESTADO, C.C.A.A. Y ORGANISMOS AUTÓNOMOS
DEPENDIENTES DE UNO U OTRAS. (Con valor nominal unitario)

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0000230161	BCO.CTO.LOCAL/4,00 CEDHIP 20071231	31/12/2007	4.000	5,41
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0000230179	BCO.CTO.LOCAL/4,00 CEDHIP 20090331	31/03/2009	4.000	5,77
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0000230195	BCO.CTO.LOCAL/4,00 CEDHIP 20101231	31/12/2010	4.000	5,41
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0000230203	BCO.CTO.LOCAL/4,00 CEDHIP 20110930	30/09/2011	4.000	5,89
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0000230211	BCO.CTO.LOCAL/4,00 CEDHIP 20120331	31/03/2012	4.000	5,53
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0000230377	BCO.CTO.LOCAL/5,00 CEDHIP 20090331	31/03/2009	5.000	6,01
EMPRESTITO DEL MAZJEN	ES0002750059	EMPTO.MAJZEN/4,00 OB 20220701	01/07/2022	4.000	21,64
EMPRESTITO DEL MAZJEN	ES0002750067	EMPTO.MAJZEN/4,00 OB 20220701	01/07/2022	4.000	114,19
GENERALIDAD VALENCIANA	ES05001058D4	GENVAL/PAG 20071003	03/10/2007		964,12

RENTA FIJA
LETRAS DEL TESORO

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Porcentaje
ESTADO	ES0L00702230	TESORO/LT 20070223	23/02/2007	C	99,078
ESTADO	ES0L00704202	TESORO/LT 20070420	20/04/2007	C	98,501
ESTADO	ES0L00706223	TESORO/LT 20070622	22/06/2007	C	97,888
ESTADO	ES0L00708179	TESORO/LT 20070817	17/08/2007	C	97,275
ESTADO	ES0L00710191	TESORO/LT 20071019	19/10/2007	C	96,667
ESTADO	ES0L00712213	TESORO/LT 20071221	21/12/2007	C	96,104
ESTADO	ES0L00802220	TESORO/LT 20080222	22/02/2008	C	95,473
ESTADO	ES0L00804184	TESORO/LT 20080418	18/04/2008	C	94,963
ESTADO	ES0L00806205	TESORO/LT 20080620	20/06/2008	C	94,487

RENTA FIJA
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	101.786,99
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845203	ABE/4,375 OB 20200330	30/03/2020	4.375	95.615,54
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211847076	ABE/3,53 OB 20090608	08/06/2009	3.530	984,50
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR-LEONESA, S.A.	ES0211843083	AUCALSA/4,00 OB 20140608	08/06/2014	4.000	489,29
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR-LEONESA, S.A.	ES0211843091	AUCALSA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3.700	476,45
AUTOPISTA VASCO-ARAGONESA, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211837077	AVASA/3,55 OB 20150615	15/06/2015	3.550	943,33
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A	ES0211839081	AUDASA/5,00 OB 20070630	30/06/2007	5.000	605,13
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A	ES0211839099	AUDASA/3,90 OB 20080327	27/03/2008	3.900	602,42
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A	ES0211839107	AUDASA/4,19 OB 20110531	31/05/2011	4.190	499,67
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A	ES0211839115	AUDASA/4,33 OB 20120516	16/05/2012	4.330	610,28
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A	ES0211839123	AUDASA/3,83 OB 20130626	26/06/2013	3.830	492,14
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A	ES0211839131	AUDASA/4,00 OB 20140608	08/06/2014	4.000	486,48
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A	ES0211839149	AUDASA/3,32 OB 20151212	12/12/2015	3.320	470,86
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A	ES0211839156	AUDASA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3.700	480,00
AUTOVIA DE LOS VIÑEDOS, S.A. CONCES. D LA JUNTA DE COMUN. D	ES0211966009	AUVISA/4,79 OB 20271215	15/12/2027	4.790	103.875,00
AYUNTAMIENTO DE MADRID	ES0201001098	AYTO.MAD/6,50 OB 20071222	22/12/2007	6.500	615,22
AYUNTAMIENTO DE MADRID	ES0201001114	AYTO.MAD/5,10 OB 20111221	21/12/2011	5.100	212.216,36
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211032	BBVA/6,97 OB SUBD 20071218	18/12/2007	6.970	155.218,17
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211065	BBVA/VAR OB SUBD 20170101	01/01/2017	V	1.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211073	BBVA/VAR OB SUBD 20130717	17/07/2013	V	100.290,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211081	BBVA/VAR OB SUBD 20151112	12/11/2015	V	101.502,67
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211099	BBVA/VAR OB SUBD 20191020	20/10/2019	V	101.372,05
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213180005	ATL/VAR OB SUBD 20080801	01/08/2008	V	599,97
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213180013	ATL/VAR OB SUBD 20101001	01/10/2010	V	599,20
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213180021	ATL/VAR OB SUBD 20111001	01/10/2011	V	599,07
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860028	SAB/VAR OB SUBD 20140218	18/02/2014	V	100.888,75
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860036	SAB/VAR OB SUBD 20160525	25/05/2016	V	99.880,97
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860044	SAB/VAR OB 20161004	04/10/2016	V	100.000,00
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980016	BVA/VAR OB SUBD 20110329	29/03/2011	V	6.022,55
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980024	BVA/VAR OB SUBD 20141215	15/12/2014	V	3.010,97
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980032	BVA/VAR OB SUBD 20150615	15/06/2015	V	50.000,70
BANCO EUROPEO DE INVERSIONES	ES0213469017	BEI/VAR OB 20080131	31/01/2008	V	631,06
BANCO EUROPEO DE INVERSIONES	ES02134690P2	BEI/5,00 OB 20071114	14/11/2007	5.000	60,76
BANCO EUROPEO DE INVERSIONES	ES0213469705	BEI/6,75 OB 20070115	15/01/2007	6.750	604,52
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051008	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20130630	30/06/2013	V	599,82
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051016	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20131030	30/10/2013	V	599,89
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051032	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20161030	30/10/2016	V	49.999,98
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051040	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD PERP	V	V	50.000,00
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580006	GUI/4,75 OB SUBD 20110415	15/04/2011	4.750	504,54
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580014	GUI/4,50 OB SUBD 20121015	15/10/2012	4.500	503,79
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580022	GUI/4,20 OB SUBD 20141015	15/10/2014	4.200	500,00
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580030	GUI/VAR OB SUBD 20160321	21/03/2016	V	99.980,23
BANCO PASTOR, S.A.	ES0213770003	PAS/VAR OB SUBD 20130930	30/09/2013	V	10.032,00
BANCO PASTOR, S.A.	ES0213770011	PAS/VAR OB SUBD PERP	V	V	100.984,59
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0213900022	SAN/8,75 OB 20081029	29/10/2008	8.750	3.272,90
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0213540000	BBE/VAR OB SUBD 20130929	29/09/2013	V	100.462,68
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0213540018	BBE/VAR OB SUBD 20160323	23/03/2016	V	99.121,02
BANKINTER, S.A.	ES0213679014	BKT/5,00 OB SUBD 20080529	29/05/2008	5.000	610,05
BANKINTER, S.A.	ES0213679022	BKT/5,70 OB SUBD 20121218	18/12/2012	5.700	6.399,91
BANKINTER, S.A.	ES0213679048	BKT/VAR OB 20090102	02/01/2009	V	24,82
BANKINTER, S.A.	ES0213679089	BKT/VAR OB 20100405	05/04/2010	V	25,15
BANKINTER, S.A.	ES0213679113	BKT/VAR OB SUBD 20140929	29/09/2014	V	100.346,56
BANKINTER, S.A.	ES0213679121	BKT/VAR OB 20150316	16/03/2015	V	487,51
BANKINTER, S.A.	ES0213679147	BKT/VAR OB SUBD 20160623	23/06/2016	V	99.750,00
BARCLAYS BANK, S.A.	ES0214050025	BARCLAYS/VAR OB SUBD 20070701	01/07/2007	V	600,00
BARCLAYS BANK, S.A.	ES0214050033	BARCLAYS/VAR OB SUBD 20090701	01/07/2009	V	600,00
BARCLAYS BANK, S.A.	ES0214050041	BARCLAYS/VAR OB SUBD 20110101	01/01/2011	V	600,00
BILBAO BIZKAIA KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA	ES0214100002	BBK/VAR OB SUBD 20150928	28/09/2015	V	99.769,12
BILBAO BIZKAIA KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA	ES0214100010	BBK/VAR OB SUBD 20160301	01/03/2016	V	99.752,88
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0257080004	BPEF/VAR OB SUBD 20140630	30/06/2014	V	1.001,94
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXANO)	ES0214958011	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20180108	08/01/2018	V	30,00
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXANO)	ES0214958029	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20180804	04/08/2018	V	600,04
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXANO)	ES0214958037	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20190126	26/01/2019	V	599,99
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXANO)	ES0214958045	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20201209	09/12/2020	V	99.835,11
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXANO)	ES0214958052	CAIXANOVA/VAR OB SUBD PERP	V	V	50.314,69
CAIXA D'ESTALVIS COMARCAL DE MANLLEU	ES0214841027	CA.MANLLEU/VAR OB SUBD 20130601	01/06/2013	V	499,93
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840060	CA.CATALUNYA/VAR OB SUBD 20100701	01/07/2010	V	1.600,15
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840094	CA.CATALUNYA/VAR OB SUBD 20110201	01/02/2011	V	1.599,36
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840201	CA.CATALUNYA/VAR OB SUBD 20150519	19/05/2015	V	1.502,53
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840235	CA.CATALUNYA/VAR OB SUBD 20200220	20/02/2020	V	1.501,56
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840250	CA.CATALUNYA/VAR OB 20120706	06/07/2012	V	99.803,01
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840300	CA.CATALUNYA/VAR OB 20261013	13/10/2026	V	50.000,00
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840318	CA.CATALUNYA/VAR OB 20131018	18/10/2013	V	49.758,99
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0213249008	CA.GIRONA/VAR OB SUBD 20160921	21/09/2016	V	99.992,12
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0214973051	CA.SABADELL/VAR OB SUBD 20200128	28/01/2020	V	100.856,73
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0314973027	CA.SABADELL/VAR OB SUBD PERP	V	V	599,23
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346000	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20150527	27/05/2015	V	600,01
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346018	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20151027	27/10/2015	V	599,95
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346026	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20160427	27/04/2016	V	599,97
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346034	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20161027	27/10/2016	V	599,94
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346042	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20170127	27/01/2017	V	500,00
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346059	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20171127	27/11/2017	V	500,01
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346067	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20180727	27/07/2018	V	499,84
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974018	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD PERP	V	V	601,01
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974034	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20131230	30/12/2013	V	1.000,59

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974042	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20190730	30/07/2019	V	1.000,12
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974067	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20210809	09/08/2021	V	100.087,47
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966006	CA.PENEDES/VAR OB SUBD PERP		V	601,06
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966014	CA.PENEDES/VAR OB SUBD PERP		V	999,67
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0214846042	CA.LAIETANA/VAR OB SUBD 20211010	10/10/2021	V	999,84
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0214846059	CA.LAIETANA/VAR OB SUBD 20350315	15/03/2035	V	1.000,02
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979066	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20111106	06/11/2011	V	999,98
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979082	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20121001	01/10/2012	V	1.000,00
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979116	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20131001	01/10/2013	V	1.000,02
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979132	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20141025	25/10/2014	V	1.000,03
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979157	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20151128	28/11/2015	V	1.000,05
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0214826002	CAJASTUR/VAR OB SUBD 20121230	30/12/2012	V	100,00
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214825012	CA.ALBACETE/VAR OB SUBD PERP		V	609,28
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214825020	CA.ALBACETE/VAR OB SUBD PERP		V	607,43
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214842017	CA.CUENCA-C.R./VAR OB SUBD PERP		V	301,61
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214842025	CA.CUENCA-C.R./VAR OB PREF PERP		V	303,16
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424013	CCM/VAR OB SUBD 20080930	30/09/2008	V	301,67
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424070	CCM/VAR OB SUBD 20090515	15/05/2009	V	300,51
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424096	CCM/VAR OB SUBD 20110604	04/06/2011	V	600,01
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424120	CCM/VAR OB SUBD 20141220	20/12/2014	V	200.554,86
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424138	CCM/VAR OB SUBD 20171214	14/12/2017	V	100.050,93
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424153	CCM/VAR OB 20130728	28/07/2013	V	99.930,91
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424161	CCM/VAR OB SUBD PERP		V	99.982,68
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843015	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD PERP		V	601,01
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843023	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD PERP		V	601,01
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843080	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20121001	01/10/2012	V	577,77
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843098	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20131103	03/11/2013	V	592,22
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843106	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20140401	01/04/2014	V	589,86
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843114	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20150104	04/01/2015	V	568,34
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843122	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20150704	04/07/2015	V	551,66
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843130	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20160912	12/09/2016	V	50.019,93
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845002	CAI/VAR OB SUBD 20131222	22/12/2013	V	999,99
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845010	CAI/VAR OB SUBD 20140629	29/06/2014	V	100.667,11
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845028	CAI/VAR OB SUBD 20160525	25/05/2016	V	49.990,00
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600035	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	302,84
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600043	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	304,73
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600050	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	300,48
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600068	CA.MURCIA/VAR OB SUBD 20081215	15/12/2008	V	300,49
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600076	CA.MURCIA/VAR OB SUBD 20081230	30/12/2008	V	300,48
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600084	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	300,49
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600092	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	300,51
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600175	CA.MURCIA/VAR OB SUBD 20141215	15/12/2014	V	299,99
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600191	CA.MURCIA/VAR OB SUBD 20230630	30/06/2023	V	499,89
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0214854012	CAJADUERO/VAR OB SUBD 20150630	30/06/2015	V	50.096,88
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0214975007	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20121010	10/10/2012	V	999,96
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0214975015	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20140330	30/03/2014	V	999,92
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0214975023	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20151213	13/12/2015	V	50.012,14
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES0214977037	BANCAJAVAR OB SUBD PERP		V	601,05
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES0214977052	BANCAJAVAR OB SUBD 20220704	04/07/2022	V	1.000,09
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES0214977060	BANCAJA/3,94 OB 20150918	18/09/2015	3.940	1.002,48
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES0214977078	BANCAJAVAR OB SUBD 20181129	29/11/2018	V	100.048,02
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES0214977086	BANCAJAVAR OB 20120606	06/06/2012	V	99.518,79
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES0214977094	BANCAJAVAR OB 20160125	25/01/2016	V	99.793,00
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES0214977102	BANCAJAVAR OB SUBD PERP		V	96.559,26
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES0214977136	BANCAJAVAR OB 20130923	23/09/2013	V	99.544,84
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES0215307028	CA.SAGUNTO/VAR OB SUBD PERP		V	606,62
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES0215307036	CA.SAGUNTO/VAR OB SUBD 20120630	30/06/2012	V	607,02
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0214957013	CA.VITAL/10,00 OB SUBD PERP		10.000	302,66
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0214400014	CAM/VAR OB SUBD PERP		V	605,44
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0214400048	CAM/VAR OB SUBD PERP		V	600,02
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0214400055	CAM/VAR OB 20150815	15/08/2015	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0215395015	CAM/VAR OB SUBD PERP		V	604,66
CAJA DE AHORROS PROVINCIAL SAN FERNANDO DE SEVILLA Y JER	ES0214969034	CA.SAN.FERN/VAR OB SUBD 20080430	30/04/2008	V	299,85
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0214926018	SA.NOSTRA/VAR OB SUBD 20141230	30/12/2014	V	100.225,74
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0214926026	SA.NOSTRA/VAR OB SUBD 20150318	18/03/2015	V	1.000,02
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0264730039	CAJASUR/VAR OB SUBD 20131201	01/12/2013	V	500,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0264730047	CAJASUR/VAR OB SUBD 20131205	05/12/2013	V	101.345,05
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0264730054	CAJASUR/VAR OB SUBD 20150311	11/03/2015	V	100.181,71
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES0214987002	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20070228	28/02/2007	V	599,98
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES0214987010	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20071201	01/12/2007	V	599,99
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES0214987028	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20171115	15/11/2017	V	499,99
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES0214987044	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20191021	21/10/2019	V	500,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES0214987069	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20200401	01/04/2020	V	500,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES0214987077	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20210425	25/04/2021	V	9.998,84
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950034	CA.MADRID/VAR OB 20090409	09/04/2009	V	95,51
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950091	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20130328	28/03/2013	V	100.279,04
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950109	CA.MADRID/4,00 OB 20110302	02/03/2011	4.000	982,40
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950117	CA.MADRID/3,76 OB 20110331	31/03/2011	3.760	972,67
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950125	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20140715	15/07/2014	V	100.224,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950133	CA.MADRID/VAR OB 20120601	01/06/2012	V	99.497,60
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950141	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20180301	01/03/2018	V	99.521,20
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950158	CA.MADRID/VAR OB 20120209	09/02/2012	V	99.830,67
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950166	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20161017	17/10/2016	V	49.931,26
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0214965008	CAN/VAR OB SUBD 20160616	16/06/2016	V	99.950,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT	ES0214955017	CA.ONTINYENT/VAR OB SUBD 20130528	28/05/2013	V	5.999,83

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT	ES0214955025	CA.ONTINYENT/VAR OB SUBD 20160428	28/04/2016	V	6.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y	ES0214954010	IBERCAJA/VAR OB PREF PERP		V	601,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y	ES0214954028	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP		V	601,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y	ES0214954036	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP		V	601,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y	ES0214954044	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP		V	601,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y	ES0214954051	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20131228	28/12/2013	V	485,04
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y	ES0214954069	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20140715	15/07/2014	V	499,24
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y	ES0214954101	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20181229	29/12/2018	V	481,81
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y	ES0214954127	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20191229	29/12/2019	V	477,65
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y	ES0214954135	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20180420	20/04/2018	V	499,86
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y	ES0214954143	IBERCAJA/VAR OB 20120720	20/07/2012	V	99.980,16
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970024	LA.CAIXA/VAR OB SUBD 20091004	04/10/2009	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970032	LA.CAIXA/VAR OB SUBD 20111010	10/10/2011	V	1.000,02
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970040	LA.CAIXA/VAR OB SUBD 20120412	12/04/2012	V	10,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970057	LA.CAIXA/VAR OB SUBD 20120722	22/07/2012	V	1.000,01
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE P	ES0215474026	CA.ESPAÑA/5,75 OB SUBD 20150627	27/06/2015	5,750	979,91
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE P	ES0215474166	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20181229	29/12/2018	V	988,32
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE P	ES0215474190	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20151207	07/12/2015	V	99.900,71
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE P	ES0215474208	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20160131	31/01/2016	V	997,01
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981013	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD PERP		V	603,37
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981039	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20321015	15/10/2032	V	299,83
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981054	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20200628	28/06/2020	V	299,77
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981070	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20151104	04/11/2015	V	99.866,18
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES0214982110	CA.GRANADA/VAR OB SUBD 20150630	30/06/2015	V	100.097,80
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983019	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP		V	301,60
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983035	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP		V	301,80
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983084	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20120801	01/08/2012	V	599,98
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983092	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20131101	01/11/2013	V	500,00
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983118	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20150412	12/04/2015	V	99.927,83
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983126	LA.CAJA/VAR OB 20111005	05/10/2011	V	100.000,00
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CRED	ES0215316029	RURALCAJA/VAR OB SUBD 20151122	22/11/2015	V	99.995,12
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0214601017	CAJAMAR/VAR OB SUBD 20150316	16/03/2015	V	99.733,99
DEUTSCHE BANK, A.G.	DE0003933693	OB. DEUTSCHE BANK	10/11/2014	4,155	985,22
DEUTSCHE BANK, SOCIEDAD ANONIMA ESPAÑOLA	ES0213320007	DT.BK.SAE/VAR OB 20070330	30/03/2007	V	100,65
DEUTSCHE BANK, SOCIEDAD ANONIMA ESPAÑOLA	ES0213320015	DT.BK.SAE/VAR OB SUBD 20131230	30/12/2013	V	93,61
DEUTSCHE BANK, SOCIEDAD ANONIMA ESPAÑOLA	ES0213320023	DT.BK.SAE/VAR OB SUBD 20140331	31/03/2014	V	94,13
DEUTSCHE BANK, SOCIEDAD ANONIMA ESPAÑOLA	ES0213320031	DT.BK.SAE/VAR OB 20150331	31/03/2015	V	94,68
ENDESA, S.A.	ES0230670210	ELE/4,20 OB 20090225	25/02/2009	4,200	100.309,16
EROSKI SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429004	EROSKI/VAR OB SUBD PERP		V	25,02
EUROPENNE POUR LE FINANCEMENT DE MATERIEL FER.	ES0233813163	EUROFIMA/11,00 OB 20141118	18/11/2014	11,000	8.833,37
EUROPENNE POUR LE FINANCEMENT DE MATERIEL FER.	ES0233813171	EUROFIMA/10,68 OB 20151103	03/11/2015	10,680	898,33
FAGOR ELECTRODOMESTICOS, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0235972009	FAGOR/VAR OB SUBD 1º PERP		V	25,05
FAGOR ELECTRODOMESTICOS, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0235972017	FAGOR/VAR OB SUBD 2º PERP		V	25,06
HELEBA FINANCE B.V.	ES0244016020	HELEBA.FINANCE/VAR OB 20070530	30/05/2007	V	601,06
IBERDROLA, S.A.	ES0244520138	IBE/6,75 OB 20121215	15/12/2012	6,750	6,54
IBERDROLA, S.A.	ES0244580116	IBE/6,00 OB 20070101	01/01/2007	6,000	6,01
IBERDROLA, S.A.	ES0244580124	IBE/6,75 OB 20080101	01/01/2008	6,750	6,03
IBERDROLA, S.A.	ES0244580520	IBE/9,30 OB 20081028	28/10/2008	9,300	659,19
IBERDROLA, S.A.	ES0244580561	IBE/8,25 OB 20091228	28/12/2009	8,250	6.738,52
IBERDROLA, S.A.	ES0274760075	SALTOS.SIL/6,75 OB 20101101	01/11/2010	6,750	6,04
IBERDROLA, S.A.	ES0274760083	SALTOS.SIL/6,75 OB 20121001	01/10/2012	6,750	6,08
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE HUELVA Y SEVILLA	ES0217156092	EL.MONTE/VAR OB SUBD PERP		V	100.751,01
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE HUELVA Y SEVILLA	ES0264870017	EL.MONTE/VAR OB SUBD PERP		V	1.516,41
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920029	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD PERP		V	608,00
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920045	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD PERP		V	600,81
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920052	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD PERP		V	600,99
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920060	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD 20211018	18/10/2021	V	599,92
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920078	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD 20230610	10/06/2023	V	599,86
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920086	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD 20250608	08/06/2025	V	599,88
NH HOTELES, S.A.	ES0261560025	NHH/6,75 OB 20090915	15/09/2009	6,750	5,89
PASTOR INTERNATIONAL CAPITAL	ES0268649029	PAS.INTL.CAP/VAR OB SUBD 20120315	15/03/2012	V	2.986,51
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0213495007	SAN.CONS.FIN/VAR OB SUBD 20160928	28/09/2016	V	49.874,67
SWEDISH EXPORT CREDIT CORPORATION	ES0277029130	SEK/VAR OB 20081105	05/11/2008	V	606,18
TELEFONICA, S.A.	ES0278430923	TEF/4,84 OB 20080303	03/03/2008	4,841	60,81
TELEFONICA, S.A.	ES0278430931	TEF/4,50 OB 20090414	14/04/2009	4,500	10.095,65
TELEFONICA, S.A.	ES0278430980	TEF/5,625 OB 20070406	06/04/2007	5,625	100.699,29
URALITA, S.A.	ES0231050032	URA/6,75 OB 20070401	01/04/2007	6,750	5,89
VIDACAIXA, S.A. DE SEGUROS Y REASEGUROS	ES0283691006	VIDACAIXA/VAR OB SUBD PERP		V	1.000,01
VIDACAIXA, S.A. DE SEGUROS Y REASEGUROS	ES0283691014	VIDACAIXA/VAR OB SUBD PERP		V	1.000,01

RENTA FIJA**BONOS**

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
ACTUACIONES ACTIVIDADES E INVERSIONES INMOBILIARIAS, S.A.	ES0306585029	AISA/5,00 BO 20110814	14/08/2011	5,000	994,09
ARRELS CT FINSOL, S.A.	ES0316927005	ARRELS.FINSOL/VAR BO 20070730	30/07/2007	V	5.001,24
AYT BONOS TESORERIA I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312348008	AYT.BO.TESOR.I/3,25 BTA 20100406 A	06/04/2010	3,250	97.699,87
AYT BONOS TESORERIA I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312348016	AYT.BO.TESOR.I/3,25 BTA 20100406 B	06/04/2010	3,250	97.260,00
AYT BONOS TESORERIA I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312348024	AYT.BO.TESOR.I/3,50 BTA 20100406 C	06/04/2010	3,500	97.336,19
AYT BONOS TESORERIA II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312271002	AYT.BO.TESOR.II/VAR BTA 20130224 A	24/02/2013	V	99.871,82
AYT BONOS TESORERIA II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312271010	AYT.BO.TESOR.II/VAR BTA 20130224 B	24/02/2013	V	100.020,20
AYT CAJA MURCIA HIPOTECARIO I, FONDO DE TITULIZACION DE AC	ES0312282025	AYT.CAMUR.H.I/VAR BTA 20381017 C	17/10/2038	V	100.047,56
AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, FONDO DE TITULIZACION DE AC	ES0312272000	AYT.CAMUR.H.II/VAR BTA 20390407 A	07/04/2039	V	100.000,00
AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, FONDO DE TITULIZACION DE AC	ES0312272018	AYT.CAMUR.H.II/VAR BTA 20390407 B	07/04/2039	V	100.000,00
AYT CAJAMURCIA HIPOTECARIO II, FONDO DE TITULIZACION DE AC	ES0312272026	AYT.CAMUR.H.II/VAR BTA 20390407 C	07/04/2039	V	100.000,00
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO:	ES0312298005	AYT.CCG/VAR BTA 20121214 I GTIA	14/12/2012	V	99.989,74
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO:	ES0312298013	AYT.CCG/3,50 BTA 20160314 II GTIA	14/03/2016	3,500	96.314,73
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO:	ES0312298021	AYT.CCG/3,75 BTA 20221214 III GTIA	14/12/2022	3,750	93.720,00
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO:	ES0312298047	AYT.CCG/3,50 BTA 20110314 V GTIA	14/03/2011	3,500	98.310,49
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO:	ES0312298054	AYT.CCG/4,00 BTA 20210324 VI GTIA	24/03/2021	4,000	96.631,59
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO:	ES0312298062	AYT.CCG/VAR BTA 20170526 VII GTIA	26/05/2017	V	99.666,31
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO:	ES0312298088	AYT.CCG/3,75 BTA 20131025 IX GTIA	25/10/2013	3,750	98.369,79
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO:	ES0312298096	AYT.CCG/4,25 BTA 20231025 X GTIA	25/10/2023	4,250	99.417,32
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO:	ES0312298104	AYT.CCG/4,00 BTA 20161220 XI GTIA	20/12/2016	4,000	99.591,90
AYT CEDULAS CAJAS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0390304006	AYT.CED.CA.II/4,50 BTA 200801128	28/11/2008	4,500	101.305,25
AYT CEDULAS CAJAS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361002001	AYT.CED.CA.III/5,25 BTA 20120628	28/06/2012	5,250	106.558,35
AYT CEDULAS CAJAS IV, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312368006	AYT.CED.CA.IV/4,00 BTA 20130313	13/03/2013	4,000	100.710,44
AYT CEDULAS CAJAS IX, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312358007	AYT.CED.CA.IX/3,75 BTA 20150331 A	31/03/2015	3,750	97.839,48
AYT CEDULAS CAJAS V, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370148019	AYT.CED.CA.V/4,75 BTA 20181204 B	04/12/2018	4,750	105.666,08
AYT CEDULAS CAJAS VI, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312360003	AYT.CED.CA.VI/4,00 BTA 20140407 A	07/04/2014	4,000	100.552,02
AYT CEDULAS CAJAS VII, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312361001	AYT.CED.CA.VII/4,00 BTA 20110623	23/06/2011	4,000	100.118,61
AYT CEDULAS CAJAS VIII, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312362009	AYT.CED.CA.VIII/4,00 BTA 20141118 A	18/11/2014	4,000	99.842,37
AYT CEDULAS CAJAS X, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312342019	AYT.CED.CA.X/3,75 BTA 20250630 B	30/06/2025	3,750	93.981,67
AYT CEDULAS TERRITORIALES CAJAS I, FONDO DE TITULIZACION D	ES0370142004	AYT.CEDTER.CA.I/3,75 BTA 20081024	24/10/2008	3,750	99.809,41
AYT DEUDA SUBORDINADA I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312284005	AYT.DEU.SUBD/VAR BTA 20161117 A	17/11/2016	V	99.999,25
AYT DEUDA SUBORDINADA I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312284013	AYT.DEU.SUBD/VAR BTA 20161117 B	17/11/2016	V	99.975,96
AYT DEUDA SUBORDINADA I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312284021	AYT.DEU.SUBD/VAR BTA 20161117 C	17/11/2016	V	100.000,00
AYT FONDO EOLICO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312376009	AYT.EOLICO/VAR BTA 20141125 E1 GTIA	25/11/2014	V	499,49
AYT FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312363007	AYT.FTPYME.II/VAR BTA 20321020 F1	20/10/2032	V	48.211,72
AYT FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312363031	AYT.FTPYME.II/VAR BTA 20321020 F3	20/10/2032	V	100.000,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECA	ES0312300009	AYT.GEN.H.IX/VAR BTH 20390715 A1	15/07/2039	V	50.000,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECA	ES0312300017	AYT.GEN.H.IX/VAR BTH 20390715 A2	15/07/2039	V	50.000,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECA	ES0312300025	AYT.GEN.H.IX/VAR BTH 20390715 B	15/07/2039	V	50.000,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECA	ES0312300033	AYT.GEN.H.IX/VAR BTH 20390715 C	15/07/2039	V	50.000,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECA	ES0312300041	AYT.GEN.H.IX/VAR BTH 20390715 D	15/07/2039	V	50.000,00
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTEC	ES0312344007	AYT.GEN.H.VIII/VAR BTH 20390515 A1	15/05/2039	V	40.191,47
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTEC	ES0312344015	AYT.GEN.H.VIII/VAR BTH 20390515 A2	15/05/2039	V	50.007,50
AYT HIPOTECARIO IV, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0312370010	AYT.HIP.IV/VAR BTH 20330613 B GTIA	13/06/2033	V	99.942,80
AYT HIPOTECARIO MIXTO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370151013	AYT.HIP.MIX.II/VAR BTA 20360620 PH2	20/06/2036	V	99.917,31
AYT HIPOTECARIO MIXTO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370151039	AYT.HIP.MIX.II/VAR BTA 20360620 CH2	20/06/2036	V	99.912,93
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312378005	AYT.HIP.MIX.III/VAR BTA 20380321 A	21/03/2038	V	64.015,81
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312378013	AYT.HIP.MIX.III/VAR BTA 20380321 B	21/03/2038	V	99.937,84
AYT HIPOTECARIO MIXTO IV, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370152003	AYT.HIP.MIX.IV/VAR BTA 20400120 A	20/01/2040	V	83.919,43
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312252002	AYT.HIP.MIX.V/VAR BTA 20410610 A	10/06/2041	V	95.589,44
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312252010	AYT.HIP.MIX.V/VAR BTA 20410610 B	10/06/2041	V	99.993,48
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312252028	AYT.HIP.MIX.V/VAR BTA 20410610 C	10/06/2041	V	99.939,81
AYT HIPOTECARIO MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312371018	AYT.HIP.MIX/VAR BTA 20330915 B GTIA	15/09/2033	V	99.936,62
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370153001	AYT.KUTXA.HIP.I/VAR BTA 20410422 A	22/04/2041	V	96.748,83
AYT PRESTAMOS CONSUMO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0361004007	AYT.PREST.C.II/VAR BTA 20141218 A	18/12/2014	V	2.080,80
AYT PRESTAMOS CONSUMO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0361004015	AYT.PREST.C.II/VAR BTA 20141218 B	18/12/2014	V	101.264,58
AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS II, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0365800000	AYT.INM.II/VAR BTA 20401210 I GTIA	10/12/2040	V	38.001,70
AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS III, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0312379003	AYT.PR.INM.III/VAR BTA 20461215 A	15/12/2046	V	57.777,81
BANCA MARCH, S.A.	ES0313040000	BCA.MARCH/VAR BO 20111013	13/10/2011	V	99.950,00
BANCAJA 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312885017	BANCAJA.6/VAR BTA 20360220 A2 GTIA	20/02/2036	V	51.304,24
BANCAJA 8, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312887005	BANCAJA.8/VAR BTA 20371025 A GTIA	25/10/2037	V	72.783,48
BANCAJA 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312888011	BANCAJA.9/VAR BTA 20430925 A2 GTIA	25/09/2043	V	95.422,60
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211130	BBVA/VAR BO 20090226	26/02/2009	V	100.018,03
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211148	BBVA/VAR BO 20080616	16/06/2008	V	99.812,67
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211171	BBVA/4,125 BO 20111220	20/12/2011	4,125	49.951,39
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860084	SAB/VAR BO 20070525	25/05/2007	V	99.945,09
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860100	SAB/VAR BO 20071129	29/11/2007	V	99.648,65
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860118	SAB/VAR BO 20080310	10/03/2008	V	99.885,11
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860126	SAB/VAR BO 20090707	07/07/2009	V	99.960,73
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860134	SAB/VAR BO 20111026	26/10/2011	V	99.987,83
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860142	SAB/VAR BO 20080618	18/06/2008	V	99.965,74
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0313980015	BVA/VAR BO 20110721	21/07/2011	V	49.975,00
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0313440119	BTO/VAR BO 20090610	10/06/2009	V	100.091,87
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0313440127	BTO/VAR BO 20071008	08/10/2007	V	99.471,57
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0313440135	BTO/VAR BO 20081028	28/10/2008	V	99.899,06
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0313580096	GUI/VAR BO SUBD 20070415	15/04/2007	V	601,01
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0313580104	GUI/4,75 BO SUBD 20070415	15/04/2007	4,750	601,31
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0313580112	GUI/5,75 BO SUBD 20090415	15/04/2009	5,750	608,59
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0313580120	GUI/VAR BO 20110321	21/03/2011	V	99.483,98
BANCO PASTOR, S.A.	ES0313770051	PAS/VAR BO 20070407	07/04/2007	V	100.014,87
BANCO PASTOR, S.A.	ES0313770069	PAS/VAR BO 20100121	21/01/2010	V	100.140,61
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0313260053	BCH/VAR BO SUBD 20110527	27/05/2011	V	7,61
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0313900344	SAN/VAR BO 20090316	16/03/2009	V	100.110,28
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0313900351	SAN/VAR BO 20070405	05/04/2007	V	99.917,62
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0313540025	BBE/VAR BO 20100222	22/02/2010	V	99.924,51

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
BANKINTER 1, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313799001	BKT.1/VAR BTH 20240422 A GTIA	22/04/2024	V	24.138,35
BANKINTER 10, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313529010	BKT.10/VAR BTA 20430621 A2 GTIA	21/06/2043	V	87.835,19
BANKINTER 11, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313714018	BKT.11/VAR BTH 20480821 A2 GTIA	21/08/2048	V	100.035,00
BANKINTER 13 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313270003	BKT.13/VAR BTA 20490717 A1 GTIA	17/07/2049	V	100.000,00
BANKINTER 13 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313270011	BKT.13/VAR BTA 20490717 A2 GTIA	17/07/2049	V	100.000,38
BANKINTER 13 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313270029	BKT.13/VAR BTA 20490717 B GTIA	17/07/2049	V	100.000,00
BANKINTER 13 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313270037	BKT.13/VAR BTA 20490717 C GTIA	17/07/2049	V	100.000,00
BANKINTER 2, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313800031	BKT.2/VAR BTH 20340722 A4 GTIA	22/07/2034	V	47.295,52
BANKINTER 2, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313800049	BKT.2/VAR BTH 20340722 B GTIA	22/07/2034	V	65.970,61
BANKINTER 3, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0314019003	BKT.3/VAR BTH 20381016 A GTIA	16/10/2038	V	46.887,32
BANKINTER 4, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313919005	BKT.4/VAR BTH 20381112 A GTIA	12/11/2038	V	56.615,47
BANKINTER 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313546006	BKT.6/VAR BTA 20380826 A GTIA	26/08/2038	V	65.170,54
BANKINTER 8, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313548010	BKT.8/VAR BTA 20401215 B GTIA	15/12/2040	V	100.000,00
BANKINTER 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313814016	BKT.9/VAR BTA 20420716 A2P GTIA	16/07/2042	V	89.799,95
BANKINTER 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313814032	BKT.9/VAR BTA 20420716 CP GTIA	16/07/2042	V	100.324,34
BANKINTER 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313814057	BKT.9/VAR BTA 20420716 A2T GTIA	16/07/2042	V	91.570,54
BANKINTER 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313814065	BKT.9/VAR BTA 20420716 BT GTIA	16/07/2042	V	101.639,75
BANKINTER I FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313922017	BKT.I.FTP/VAR BTA 20300315 T2 GTIA	15/03/2030	V	29.118,97
BANKINTER, S.A.	ES0313679401	BKT/VAR BO 20071217	17/12/2007	V	99.997,51
BANKINTER, S.A.	ES0313679419	BKT/VAR BO 20081010	10/10/2008	V	99.902,57
BANKINTER, S.A.	ES0313679427	BKT/VAR BO 20101118	18/11/2010	V	99.615,96
BANKINTER, S.A.	ES0313679435	BKT/VAR BO 20110601	01/06/2011	V	99.779,31
BBVA AUTOS 1 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314204001	BBVA.AUTOS.1/VAR BTA 20160620 A	20/06/2016	V	89.243,82
BBVA AUTOS 2 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0333761007	BBVA.AUTOS.2/VAR BTA 20191120 A	20/11/2019	V	100.024,97
BBVA CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0333763003	BBVA.CONSUMO.1/VAR BTA 20200120 A	20/01/2020	V	99.941,55
BBVA CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0333763029	BBVA.CONSUMO.1/VAR BTA 20200120 C	20/01/2020	V	100.000,00
BBVA CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313956007	BBVA.CONSUMO.2/VAR BTA 20201220 A	20/12/2020	V	99.998,65
BBVA CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313956015	BBVA.CONSUMO.2/VAR BTA 20201220 B	20/12/2020	V	99.986,71
BBVA CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313956023	BBVA.CONSUMO.2/VAR BTA 20201220 C	20/12/2020	V	99.996,79
BBVA HIPOTECARIO 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0314227010	BBVA.HIP.3/VAR BTA 20381121 A2 GTIA	21/11/2038	V	100.014,70
BBVA HIPOTECARIO 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0314227036	BBVA.HIP.3/VAR BTA 20381121 C GTIA	21/11/2038	V	100.222,73
BBVA-3 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0310110004	BBVA3.FTP/VAR BTA 20280421 A1 GTIA	21/04/2028	V	43.388,74
BBVA-3 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0310110038	BBVA3.FTP/VAR BTA 20280421 C GTIA	21/04/2028	V	100.360,00
BBVA-4 PYME, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370458004	BBVA4.PYME/VAR BTA 20070219 A1 GTIA	19/02/2007	V	99.995,66
BBVA-4 PYME, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370458012	BBVA4.PYME/VAR BTA 20380819 A2 GTIA	19/08/2038	V	100.010,00
BBVA-4 PYME, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370458020	BBVA4.PYME/VAR BTA 20380819 B GTIA	19/08/2038	V	100.042,89
BBVA-5 FTPYME, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370459002	BBVA5.FTP/VAR BTA 20390315 A1 GTIA	15/03/2039	V	99.996,63
BBVA-5 FTPYME, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370459010	BBVA5.FTP/VAR BTA 20390315 A2 GTIA	15/03/2039	V	100.000,00
BBVA-5 FTPYME, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370459028	BBVA5.FTP/VAR BTA 20390315 A3G GTIA	15/03/2039	V	100.000,00
BBVA-5 FTPYME, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370459036	BBVA5.FTP/VAR BTA 20390315 B GTIA	15/03/2039	V	100.000,00
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080003	BPEF/VAR BO 20070730	30/07/2007	V	99.910,64
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080011	BPEF/VAR BO 20090730	30/07/2009	V	99.951,87
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080052	BPEF/VAR BO 20100526	26/05/2010	V	99.975,00
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080060	BPEF/VAR BO 20070123	23/01/2007	V	99.978,68
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080078	BPEF/VAR BO 20080908	08/09/2008	V	100.055,23
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080086	BPEF/VAR BO 20110118	18/01/2011	V	99.780,00
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080094	BPEF/VAR BO 20090210	10/02/2009	V	99.769,28
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080102	BPEF/VAR BO 20070913	13/09/2007	V	99.926,04
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080110	BPEF/VAR BO 20090522	22/05/2009	V	99.831,92
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080136	BPEF/VAR BO 20100728	28/07/2010	V	99.248,43
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXANO)	ES0314958028	CAIXANOVA/VAR BO 20110314	14/03/2011	V	49.926,20
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840051	CA.CATALUNYA/VAR BO 20091201	01/12/2009	V	99.830,25
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840135	CA.CATALUNYA/4,00 BO 20081215	15/12/2008	4.000	50.000,00
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0315346009	CA.TARRAGONA/VAR BO 20110411	11/04/2011	V	99.894,00
CAIXA PENEDES 1 TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313252001	CA.PENEDES1.TDA/VAR BTA 20430128 A	28/01/2043	V	99.997,01
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843170	CAIXAGALICIA/3,25 BO 20080401	01/04/2008	3.250	493,27
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843188	CAIXAGALICIA/3,25 BO 20080801	01/08/2008	3.250	493,26
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843196	CAIXAGALICIA/3,25 BO 20090902	02/09/2009	3.250	481,45
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843204	CAIXAGALICIA/2,60 BO 20081115	15/11/2008	2.600	480,45
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843212	CAIXAGALICIA/VAR BO 20101129	29/11/2010	V	99.900,00
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843220	CAIXAGALICIA/VAR BO 20090508	08/05/2009	V	49.839,60
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843238	CAIXAGALICIA/VAR BO 20111108	08/11/2011	V	49.985,18
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0314975006	CA.CANTABRIA/VAR BO 20100406	06/04/2010	V	100.009,00
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES0314977101	BANCAJA/3,95 BO 20110430	30/04/2011	3.950	602,12
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES0314977119	BANCAJA/3,95 BO 20110601	01/06/2011	3.950	602,29
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES0314977168	BANCAJA/VAR BO 20100110	10/01/2010	V	604,18
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES0314977200	BANCAJA/VAR BO 20090227	27/02/2009	V	9.986,12
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES0314977218	BANCAJA/VAR BO 20100225	25/02/2010	V	99.995,77
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES0314977226	BANCAJA/VAR BO 20081110	10/11/2008	V	99.438,52
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES0314977234	BANCAJA/VAR BO 20070713	13/07/2007	V	99.858,58
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES0314977242	BANCAJA/VAR BO 20110510	10/05/2011	V	99.752,44
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0315308116	CA.VITAL/VAR BO 20070126	26/01/2007	V	100.000,00
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0315308124	CA.VITAL/VAR BO 20080930	30/09/2008	V	1.001,44
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0315308132	CA.VITAL/VAR BO 20071003	03/10/2007	V	99.996,67
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400047	CAM/VAR BO 20090615	15/06/2009	V	100.076,67
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400054	CAM/VAR BO 20100114	14/01/2010	V	99.787,96
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400062	CAM/VAR BO 20110203	03/02/2011	V	99.906,69
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES0314961030	CA.BURGOS/VAR BO 20090309	09/03/2009	V	99.976,34
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES0314961048	CA.BURGOS/VAR BO 20100202	02/02/2010	V	99.910,00
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES0314961055	CA.BURGOS/VAR BO 20080409	09/04/2008	V	99.979,54
CAJA DE AHORROS PROVINCIAL SAN FERNANDO DE SEVILLA Y JER	ES0314969017	CA.SAN.FERN/VAR BO 20090302	02/03/2009	V	99.523,43
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950041	CA.MADRID/5,63 BO 20070528	28/05/2007	5.630	605,89
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950058	CA.MADRID/5,63 BO 20070602	02/06/2007	5.630	606,03
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950066	CA.MADRID/5,00 BO 20071229	29/12/2007	5.000	606,38
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950074	CA.MADRID/4,9089 BO SUBD 20100406	06/04/2010	4.909	605,36

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
TDA 15 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377979002	TDA.15-MIX/VAR BTA 20320628 A1 GTIA	28/06/2032	V	52.762,08
TDA 15 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377979028	TDA.15-MIX/VAR BTA 20420627 A2 GTIA	27/06/2042	V	46.288,45
TDA 16 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377973005	TDA.16-MIX/VAR BTA 20350322 A1 GTIA	22/03/2035	V	42.566,25
TDA 16 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377973021	TDA.16-MIX/VAR BTA 20350322 A2 GTIA	22/03/2035	V	45.721,34
TDA 20 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377981008	TDA.20-MIX/VAR BTA 20360426 A1 GTIA	26/04/2036	V	70.307,57
TDA 20 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377981024	TDA.20-MIX/VAR BTA 20360426 A2 GTIA	26/04/2036	V	64.268,64
TDA 24, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377952033	TDA.24/VAR BTA 20400622 C GTIA	22/06/2040	V	100.202,94
TDA 25, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377929007	TDA.25/VAR BTA 20410322 A GTIA	22/03/2041	V	94.483,57
TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377954005	TDA.27/VAR BTA 20501228 A1 GTIA	28/12/2050	V	100.000,00
TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377954013	TDA.27/VAR BTA 20501228 A2 GTIA	28/12/2050	V	100.000,00
TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377954021	TDA.27/VAR BTA 20501228 A3 GTIA	28/12/2050	V	100.000,00
TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377954039	TDA.27/VAR BTA 20501228 B GTIA	28/12/2050	V	100.000,00
TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377954047	TDA.27/VAR BTA 20501228 C GTIA	28/12/2050	V	100.000,00
TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377954054	TDA.27/VAR BTA 20501228 D GTIA	28/12/2050	V	100.000,00
TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377954062	TDA.27/VAR BTA 20501228 E GTIA	28/12/2050	V	100.000,00
TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377954088	TDA.27/VAR BTA 20091228 IO GTIA	28/12/2009	V	16.000,00
TDA 7, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0308184029	TDA.7/VAR BTH 20281117 A3 GTIA	17/11/2028	V	31.574,02
TDA CAJAMAR 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377965019	TDA.CAJAMAR.2/VAR BTA 20410626 A2	26/06/2041	V	89.043,07
TDA CAM 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377990009	TDA.CAM.3/VAR BTA 20330426 A GTIA	26/04/2033	V	60.636,65
TDA CAM 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377991007	TDA.CAM.4/VAR BTA 20390626 A GTIA	26/06/2039	V	73.395,20
TDA CAM 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377992005	TDA.CAM.5/VAR BTA 20431026 A GTIA	26/10/2043	V	86.347,65
TDA CAM 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377992013	TDA.CAM.5/VAR BTA 20431026 B GTIA	26/10/2043	V	100.084,63
TDA CAM 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377993003	TDA.CAM.6/VAR BTA 20120728 A1 GTIA	28/07/2012	V	91.680,59
TDA CAM 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377993029	TDA.CAM.6/VAR BTA 20440428 A3 GTIA	28/04/2044	V	92.645,21
TDA CAM 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377994001	TDA.CAM.7/VAR BTA 20490226 A1 GTIA	26/02/2049	V	99.951,08
TDA CAM 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377994019	TDA.CAM.7/VAR BTA 20490226 A2 GTIA	26/02/2049	V	99.955,18
TDA CAM 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377994027	TDA.CAM.7/VAR BTA 20490226 A3 GTIA	26/02/2049	V	99.950,00
TDA CAM 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377994035	TDA.CAM.7/VAR BTA 20490226 B GTIA	26/02/2049	V	99.950,00
TDA IBERCAJA 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0338452008	TDA.IBERCAJA.3/VAR BTA 20431228 A	28/12/2043	V	92.601,73
TDA IBERCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0338453006	TDA.IBERCAJA.4/VAR BTA 20440826 A1	26/08/2044	V	99.958,17
TDA IBERCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0338453014	TDA.IBERCAJA.4/VAR BTA 20440826 A2	26/08/2044	V	99.951,10
TDA IBERCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0338453022	TDA.IBERCAJA.4/VAR BTA 20440826 A3P	26/08/2044	V	99.959,98
TDA IBERCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0338453030	TDA.IBERCAJA.4/VAR BTA 20440826 B	26/08/2044	V	99.950,00
TDA IBERCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0338453048	TDA.IBERCAJA.4/VAR BTA 20440826 C	26/08/2044	V	99.950,00
TDA IBERCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0338453055	TDA.IBERCAJA.4/VAR BTA 20440826 D	26/08/2044	V	99.930,00
TDA IBERCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0338453063	TDA.IBERCAJA.4/VAR BTA 20440826 E	26/08/2044	V	99.920,00
TELE PIZZA, S.A.	ES0378344008	TPZ/VAR BO 20090421	21/04/2009	V	32,02
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0382746008	VALENCIA.HIP.3/VAR BTA 20440922 A1	22/09/2044	V	99.999,28
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0382746016	VALENCIA.HIP.3/VAR BTA 20440922 A2	22/09/2044	V	99.998,31
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0382746032	VALENCIA.HIP.3/VAR BTA 20440922 C	22/09/2044	V	100.000,00
VALENCIA HIPOTECARIO 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0382746040	VALENCIA.HIP.3/VAR BTA 20440922 D	22/09/2044	V	100.000,00

RENTA FIJA**CEDULAS**

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211006	BBVA/5,50 CEDHIP 20091015 GTIA	15/10/2009	5.500	105.040,50
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211014	BBVA/5,75 CEDHIP 20100927 GTIA	27/09/2010	5.750	106.195,79
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211022	BBVA/4,25 CEDHIP 20070926 GTIA	26/09/2007	4.250	100.350,68
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211030	BBVA/4,25 CEDHIP 20130129 GTIA	29/01/2013	4.250	101.869,51
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211048	BBVA/3,50 CEDHIP 20110315 GTIA	15/03/2011	3.500	98.314,16
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211055	BBVA/4,25 CEDHIP 20140715 GTIA	15/07/2014	4.250	101.548,81
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211063	BBVA/3,00 CEDHIP 20091203 GTIA	03/12/2009	3.000	97.364,26
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211071	BBVA/4,00 CEDHIP 20250225 GTIA	25/02/2025	4.000	96.649,44
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211089	BBVA/3,50 CEDHIP 20150225 GTIA	25/02/2015	3.500	97.083,77
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211097	BBVA/2,75 CEDHIP 20100607 GTIA	07/06/2010	2.750	96.473,82
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211105	BBVA/3,50 CEDHIP 20201007 GTIA	07/10/2020	3.500	93.581,33
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211113	BBVA/3,25 CEDHIP 20160124 GTIA	24/01/2016	3.250	93.358,01
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211121	BBVA/3,50 CEDHIP 20210124 GTIA	24/01/2021	3.500	91.992,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211139	BBVA/3,875 CEDHIP 20120531 GTIA	31/05/2012	3.875	99.849,45
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211154	BBVA/3,75 CEDHIP 20131004 GTIA	04/10/2013	3.750	99.145,71
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211162	BBVA/3,75 CEDTER 20111123 GTIA	23/11/2011	3.750	99.633,61
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0424207001	ARGENTARIA/4,375 CEDHIP 20090405	05/04/2009	4.375	101.296,86
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0400230001	BCO.CTO.LOCAL/3,75 CEDTER 20100407	07/04/2010	3.750	99.806,89
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0400230019	BCO.CTO.LOCAL/3,75 CEDTER 20090630	30/06/2009	3.750	99.721,92
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0400230050	BCO.CTO.LOCAL/2,75 CEDTER 20080317	17/03/2008	2.750	98.731,30
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0400230068	BCO.CTO.LOCAL/3,75 CEDTER 20111020	20/10/2011	3.750	99.399,53
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860000	SAB/4,50 CEDHIP 20130429 GTIA	29/04/2013	4.500	103.267,60
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860018	SAB/3,75 CEDHIP 20110126 GTIA	26/01/2011	3.750	99.266,97
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860026	SAB/3,25 CEDHIP 20150615 GTIA	15/06/2015	3.250	94.390,94
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860034	SAB/3,50 CEDHIP 20160119 GTIA	19/01/2016	3.500	95.583,18
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440027	BTO/5,75 CEDHIP 20170327 GTIA	27/03/2017	5.750	114.560,00
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440035	BTO/4,00 CEDHIP 20100512 GTIA	12/05/2010	4.000	100.238,05
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440043	BTO/3,75 CEDHIP 20110223 GTIA	23/02/2011	3.750	99.162,16
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440050	BTO/4,25 CEDHIP 20140916 GTIA	16/09/2014	4.250	101.849,14
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440068	BTO/3,50 CEDHIP 20150127 GTIA	27/01/2015	3.500	96.767,70
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440076	BTO/2,75 CEDHIP 20120907 GTIA	07/09/2012	2.750	93.896,33
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440084	BTO/3,50 CEDHIP 20160118 GTIA	18/01/2016	3.500	96.811,28
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440092	BTO/4,25 CEDHIP 20130712 GTIA	12/07/2013	4.250	101.385,00
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770001	PAS/3,75 CEDHIP 20150304 GTIA	04/03/2015	3.750	97.310,70
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770019	PAS/3,875 CEDHIP 20130920 GTIA	20/09/2013	3.875	98.951,41
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790009	POP/3,00 CEDHIP 20121018 GTIA	18/10/2012	3.000	95.163,07
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790017	POP/4,00 CEDHIP 20161018 GTIA	18/10/2016	4.000	99.744,15
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0413900004	SAN/4,00 CEDHIP 20071001 GTIA	01/10/2007	4.000	100.187,44
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0413900020	SAN/4,00 CEDTER 20130708 GTIA	08/07/2013	4.000	100.770,00
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0413900038	SAN/4,00 CEDHIP 20100910 GTIA	10/09/2010	4.000	100.561,32
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0413900046	SAN/3,75 CEDHIP 20081219 GTIA	19/12/2008	3.750	99.737,71
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0413900053	SAN/3,25 CEDHIP 20090315 GTIA	15/03/2009	3.250	98.372,56
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0413900061	SAN/4,50 CEDHIP 20160729 GTIA	29/07/2016	4.500	102.609,06
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0413900079	SAN/3,25 CEDHIP 20120207 GTIA	07/02/2012	3.250	97.309,59
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0413900087	SAN/4,00 CEDHIP 20200407 GTIA	07/04/2020	4.000	99.093,41
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0413900095	SAN/2,50 CEDHIP 20110128 GTIA	28/01/2011	2.500	94.853,54
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0413900103	SAN/3,125 CEDHIP 20150928 GTIA	28/09/2015	3.125	93.574,39
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0413900111	SAN/3,50 CEDHIP 20140206 GTIA	06/02/2014	3.500	97.095,85
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0413900129	SAN/3,875 CEDHIP 20260206 GTIA	06/02/2026	3.875	95.417,59
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0413900137	SAN/3,75 CEDHIP 20110908 GTIA	08/09/2011	3.750	99.393,85
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0413900145	SAN/4,125 CEDHIP 20170109 GTIA	09/01/2017	4.125	99.936,32
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXANO)	ES0414958092	CAIXANOVA/VAR CEDHIP 20081006 GTIA	06/10/2008	V	600,02
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0414840274	CA.CATALUNYA/3,50 CEDHIP 20160307	07/03/2016	3.500	96.800,48
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0414840290	CA.CATALUNYA/4,015 CEDHIP 20161109	09/11/2016	4.015	100.000,00
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0414854010	CAJADUERO/VAR CEDHIP 20091029 GTIA	29/10/2009	V	998,07
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0414854028	CAJADUERO/VAR CEDHIP 20091229 GTIA	29/12/2009	V	1.000,22
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950602	CA.MADRID/3,75 CEDHIP 20091022 GTIA	22/10/2009	3.750	99.919,98
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950610	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20110325 GTIA	25/03/2011	3.500	98.491,76
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950628	CA.MADRID/4,00 CEDHIP 20250203 GTIA	03/02/2025	4.000	97.488,45
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950636	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20151214 GTIA	14/12/2015	3.500	96.947,33
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950644	CA.MADRID/4,125 CEDHIP 20360324	24/03/2036	4.125	49.014,61
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950651	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20180525 GTIA	25/05/2018	4.250	50.560,56
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950669	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20160705 GTIA	05/07/2016	4.250	50.823,02
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970139	LA.CAIXA/5,25 CEDHIP 20110405 GTIA	05/04/2011	5.250	105.833,71
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970162	LA.CAIXA/4,50 CEDHIP 20121121 GTIA	21/11/2012	4.500	103.334,10
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970170	LA.CAIXA/3,50 CEDHIP 20100301 GTIA	01/03/2010	3.500	98.743,49
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970188	LA.CAIXA/4,25 CEDHIP 20131031 GTIA	31/10/2013	4.250	101.456,92
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970196	LA.CAIXA/4,75 CEDHIP 20181031 GTIA	31/10/2018	4.750	106.873,70
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970204	LA.CAIXA/3,875 CEDHIP 20250217 GTIA	17/02/2025	3.875	96.490,40
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970212	LA.CAIXA/3,25 CEDHIP 20151005 GTIA	05/10/2015	3.250	94.473,55
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970238	LA.CAIXA/3,375 CEDHIP 20140630 GTIA	30/06/2014	3.375	48.088,14
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970246	LA.CAIXA/3,625 CEDHIP 20210118 GTIA	18/01/2021	3.625	48.398,96
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970253	LA.CAIXA/VAR CEDHIP 20160630 GTIA	30/06/2016	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970295	LA.CAIXA/4,25 CEDHIP 20170126 GTIA	26/01/2017	4.250	50.826,84
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970303	LA.CAIXA/4,50 CEDHIP 20220126 GTIA	26/01/2022	4.500	51.732,99
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970311	LA.CAIXA/3,75 CEDTER 20110913 GTIA	13/09/2011	3.750	49.506,85
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970329	LA.CAIXA/VAR CEDHIP 20131018 GTIA	18/10/2013	V	50.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970345	LA.CAIXA/VAR CEDHIP 20161128 GTIA	28/11/2016	V	49.955,00
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0414981219	CAJACANARIAS/VAR CEDHIP 20090618	18/06/2009	V	399,00
DEXIA SABADELL BANCO LOCAL, S.A.	ES0426396067	DEXIA.SAB/VAR CEDTER 20100612 GTIA	12/06/2010	V	100.000,00
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0413495005	SAN.CONS.FIN/3,875 CEDHIP 20160323	23/03/2016	3.875	99.126,71

RENTA FIJA**PAGARÉS**

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845218	ABE/PAG 20070626	26/06/2007	C	97.625,87
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845234	ABE/PAG 20070105	05/01/2007	C	99.804,49
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845291	ABE/PAG 20070123	23/01/2007	C	99.149,48
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845317	ABE/PAG 20070126	26/01/2007	C	99.442,50
AYT AUTOMOCION I MMC ESPAÑA, FONDO DE TITULIZACION DE AC	ES0512354095	AUTO.I.MMC/PAG 20070209	09/02/2007	C	99.098,21
AYT AUTOMOCION II COFIBER E.F.C., FONDO DE TITULIZACION DE A	ES0512211022	AUTO.II.COF/PAG 20070105	05/01/2007	C	99.620,53
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040AI9	BCA.MARCH/PAG 20070417	17/04/2007	C	982,56
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040AS8	BCA.MARCH/PAG 20070430	30/04/2007	C	982,46
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040BU2	BCA.MARCH/PAG 20070620	20/06/2007	C	978,67
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040CQ8	BCA.MARCH/PAG 20070614	14/06/2007	C	981,92
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040DF9	BCA.MARCH/PAG 20070125	25/01/2007	C	991,05
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040DN3	BCA.MARCH/PAG 20070808	08/08/2007	C	975,47
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040DO1	BCA.MARCH/PAG 20070102	02/01/2007	C	991,12
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040EX0	BCA.MARCH/PAG 20070330	30/03/2007	C	982,26
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040EY8	BCA.MARCH/PAG 20070928	28/09/2007	C	964,60
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040FE7	BCA.MARCH/PAG 20071004	04/10/2007	C	964,24
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040FF4	BCA.MARCH/PAG 20070109	09/01/2007	C	991,35
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040FG2	BCA.MARCH/PAG 20070410	10/04/2007	C	982,32
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040FI8	BCA.MARCH/PAG 20070110	10/01/2007	C	991,29
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040FJ6	BCA.MARCH/PAG 20071009	09/10/2007	C	963,56
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040FL2	BCA.MARCH/PAG 20071011	11/10/2007	C	965,43
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040FO6	BCA.MARCH/PAG 20071018	18/10/2007	C	963,03
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040FW9	BCA.MARCH/PAG 20071026	26/10/2007	C	963,36
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040GA3	BCA.MARCH/PAG 20071031	31/10/2007	C	963,50
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040GB1	BCA.MARCH/PAG 20070503	03/05/2007	C	982,58
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040GI6	BCA.MARCH/PAG 20071108	08/11/2007	C	964,30
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040GL0	BCA.MARCH/PAG 20071109	09/11/2007	C	963,12
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040GO4	BCA.MARCH/PAG 20070517	17/05/2007	C	982,52
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040GP1	BCA.MARCH/PAG 20070220	20/02/2007	C	993,84
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040GX5	BCA.MARCH/PAG 20071126	26/11/2007	C	962,35
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040GZ0	BCA.MARCH/PAG 20071128	28/11/2007	C	964,12
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040HH6	BCA.MARCH/PAG 20071207	07/12/2007	C	962,77
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040U75	BCA.MARCH/PAG 20070112	12/01/2007	C	994,90
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040V58	BCA.MARCH/PAG 20070202	02/02/2007	C	991,60
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040W08	BCA.MARCH/PAG 20070212	12/02/2007	C	991,08
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040X98	BCA.MARCH/PAG 20070305	05/03/2007	C	991,31
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040Z13	BCA.MARCH/PAG 20070322	22/03/2007	C	985,81
BANCA PUEYO, S.A.	ES0512871510	BCA.PUEYO/PAG 20070914	14/09/2007	C	968,03
BANCA PUEYO, S.A.	ES0512871569	BCA.PUEYO/PAG 20080509	09/05/2008	C	948,47
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0513140ZU9	AND/PAG 20070115	15/01/2007	C	2.983,66
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131410B1	AND/PAG 20070525	25/05/2007	C	2.944,82
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131410F2	AND/PAG 20070103	03/01/2007	C	2.996,62
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131410Z0	AND/PAG 20070629	29/06/2007	C	2.941,90
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131411A1	AND/PAG 20070105	05/01/2007	C	2.990,20
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131412G6	AND/PAG 20070420	20/04/2007	C	2.945,86
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131412K8	AND/PAG 20070928	28/09/2007	C	2.891,66
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131412P7	AND/PAG 20070817	17/08/2007	C	2.912,30
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131412V5	AND/PAG 20070824	24/08/2007	C	2.924,42
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0513141319	AND/PAG 20070223	23/02/2007	C	2.981,13
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131414D9	AND/PAG 20070108	08/01/2007	C	2.990,72
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131414F4	AND/PAG 20070104	04/01/2007	C	2.995,88
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131414I8	AND/PAG 20070111	11/01/2007	C	2.995,71
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131414K4	AND/PAG 20070110	10/01/2007	C	2.993,71
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131414L2	AND/PAG 20070124	24/01/2007	C	2.978,32
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131414P3	AND/PAG 20071116	16/11/2007	C	2.886,79
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131414R9	AND/PAG 20070518	18/05/2007	C	2.953,49
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131414U3	AND/PAG 20070205	05/02/2007	C	2.985,97
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131415A2	AND/PAG 20071214	14/12/2007	C	2.886,82
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES05131415H7	AND/PAG 20070921	21/09/2007	C	2.913,94
BANCO DE GALICIA, S.A.	ES05135164D6	GAL/PAG 20071130	30/11/2007	C	2.892,30
BANCO DE GALICIA, S.A.	ES05135164U0	GAL/PAG 20070122	22/01/2007	C	2.982,29
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860KC2	SAB/PAG 20070105	05/01/2007	C	996,42
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860KM1	SAB/PAG 20070116	16/01/2007	C	993,86
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860KR0	SAB/PAG 20070126	26/01/2007	C	995,89
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860KU4	SAB/PAG 20070129	29/01/2007	C	990,12
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860KY6	SAB/PAG 20070202	02/02/2007	C	992,01
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860LH9	SAB/PAG 20070212	12/02/2007	C	991,69
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860LQ0	SAB/PAG 20070228	28/02/2007	C	989,39
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860MA2	SAB/PAG 20070312	12/03/2007	C	988,65
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860MC8	SAB/PAG 20070315	15/03/2007	C	991,08
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860NL7	SAB/PAG 20070119	19/01/2007	C	996,38
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860NM5	SAB/PAG 20070219	19/02/2007	C	989,09
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860NN3	SAB/PAG 20070320	20/03/2007	C	991,04
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860NO1	SAB/PAG 20070419	19/04/2007	C	982,70
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860OE0	SAB/PAG 20070511	11/05/2007	C	983,39
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860OH3	SAB/PAG 20070515	15/05/2007	C	982,55
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860OW2	SAB/PAG 20070615	15/06/2007	C	981,77
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860OZ5	SAB/PAG 20070620	20/06/2007	C	981,51
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860PG2	SAB/PAG 20070628	28/06/2007	C	980,98
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860PH0	SAB/PAG 20070629	29/06/2007	C	976,89
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860PI8	SAB/PAG 20070110	10/01/2007	C	994,47
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860PK4	SAB/PAG 20070115	15/01/2007	C	995,02
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860PO6	SAB/PAG 20070103	03/01/2007	C	996,86
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860PX7	SAB/PAG 20070108	08/01/2007	C	996,64
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860QB1	SAB/PAG 20070104	04/01/2007	C	996,97

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860QH8	SAB/PAG 20070131	31/01/2007	C	991,04
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860QJ4	SAB/PAG 20071031	31/10/2007	C	963,50
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860QQ9	SAB/PAG 20070222	22/02/2007	C	992,53
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860QU1	SAB/PAG 20070102	02/01/2007	C	994,31
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860QW7	SAB/PAG 20070410	10/04/2007	C	982,06
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860QX5	SAB/PAG 20070326	26/03/2007	C	990,17
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860RI4	SAB/PAG 20070122	22/01/2007	C	993,27
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860RP9	SAB/PAG 20070112	12/01/2007	C	997,31
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860RQ7	SAB/PAG 20070329	29/03/2007	C	991,15
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860RR5	SAB/PAG 20070330	30/03/2007	C	982,66
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860RT1	SAB/PAG 20070416	16/04/2007	C	982,14
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860RU9	SAB/PAG 20070403	03/04/2007	C	984,84
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860RV7	SAB/PAG 20071004	04/10/2007	C	965,19
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860RW5	SAB/PAG 20070109	09/01/2007	C	995,59
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860SB7	SAB/PAG 20070117	17/01/2007	C	995,82
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860SC5	SAB/PAG 20070118	18/01/2007	C	996,95
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860SF8	SAB/PAG 20070123	23/01/2007	C	997,39
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860SH4	SAB/PAG 20070427	27/04/2007	C	982,14
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860SJ0	SAB/PAG 20070727	27/07/2007	C	972,22
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860SN2	SAB/PAG 20070205	05/02/2007	C	991,41
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860SO0	SAB/PAG 20070130	30/01/2007	C	995,78
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860SP7	SAB/PAG 20070206	06/02/2007	C	994,40
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860SQ5	SAB/PAG 20071105	05/11/2007	C	962,66
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860SR3	SAB/PAG 20071106	06/11/2007	C	964,29
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860SX1	SAB/PAG 20070215	15/02/2007	C	994,24
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860TA7	SAB/PAG 20070111	11/01/2007	C	998,63
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860TC3	SAB/PAG 20070124	24/01/2007	C	996,75
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860TE9	SAB/PAG 20070524	24/05/2007	C	983,04
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860TF6	SAB/PAG 20070302	02/03/2007	C	991,70
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860TJ8	SAB/PAG 20071205	05/12/2007	C	963,72
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860TM2	SAB/PAG 20071214	14/12/2007	C	963,52
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135802M2	GUI/PAG 20070131	31/01/2007	C	991,04
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135802R1	GUI/PAG 20070228	28/02/2007	C	987,26
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135802S9	GUI/PAG 20070221	21/02/2007	C	987,82
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135802V3	GUI/PAG 20070314	14/03/2007	C	990,89
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135802X9	GUI/PAG 20070321	21/03/2007	C	991,51
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135803A5	GUI/PAG 20070117	17/01/2007	C	994,01
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135803B3	GUI/PAG 20070410	10/04/2007	C	982,22
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135803E7	GUI/PAG 20070418	18/04/2007	C	987,19
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135803L2	GUI/PAG 20070613	13/06/2007	C	982,05
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135803P3	GUI/PAG 20070103	03/01/2007	C	991,03
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135803S7	GUI/PAG 20071219	19/12/2007	C	961,86
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135803T5	GUI/PAG 20070404	04/04/2007	C	982,27
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135803X7	GUI/PAG 20070110	10/01/2007	C	993,10
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135804C9	GUI/PAG 20070725	25/07/2007	C	972,34
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135804G0	GUI/PAG 20070307	07/03/2007	C	985,27
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135804M8	GUI/PAG 20071003	03/10/2007	C	963,86
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135804N6	GUI/PAG 20070502	02/05/2007	C	981,40
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135804P1	GUI/PAG 20071010	10/10/2007	C	963,93
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135804R7	GUI/PAG 20070112	12/01/2007	C	991,28
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135804T3	GUI/PAG 20070425	25/04/2007	C	983,00
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135804W7	GUI/PAG 20070214	14/02/2007	C	991,35
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135805A0	GUI/PAG 20071121	21/11/2007	C	964,65
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135805C6	GUI/PAG 20071128	28/11/2007	C	962,15
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135805D4	GUI/PAG 20070604	04/06/2007	C	981,89
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135805E2	GUI/PAG 20071205	05/12/2007	C	962,93
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770GO6	PAS/PAG 20070627	27/06/2007	C	981,18
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770GW9	PAS/PAG 20070104	04/01/2007	C	991,41
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770IV7	PAS/PAG 20070216	16/02/2007	C	991,10
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770JH4	PAS/PAG 20070228	28/02/2007	C	989,36
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770JJ0	PAS/PAG 20070305	05/03/2007	C	991,20
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770KW1	PAS/PAG 20070410	10/04/2007	C	982,37
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770LC1	PAS/PAG 20070424	24/04/2007	C	982,56
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770LJ6	PAS/PAG 20070502	02/05/2007	C	979,45
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770LZ2	PAS/PAG 20070521	21/05/2007	C	982,18
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770MI6	PAS/PAG 20070606	06/06/2007	C	981,82
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770MR7	PAS/PAG 20070620	20/06/2007	C	981,80
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770NO2	PAS/PAG 20070122	22/01/2007	C	995,40
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770OK8	PAS/PAG 20070315	15/03/2007	C	991,54
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770OZ6	PAS/PAG 20071003	03/10/2007	C	963,65
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770PF5	PAS/PAG 20070117	17/01/2007	C	995,87
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770PG3	PAS/PAG 20071019	19/10/2007	C	963,00
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770QB2	PAS/PAG 20071120	20/11/2007	C	962,18
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770QD8	PAS/PAG 20070105	05/01/2007	C	997,05
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770QF3	PAS/PAG 20070529	29/05/2007	C	982,21
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770QR8	PAS/PAG 20071207	07/12/2007	C	962,84
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770QS6	PAS/PAG 20071214	14/12/2007	C	962,65
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770QV0	PAS/PAG 20070619	19/06/2007	C	981,34
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES05138047W0	POP/PAG 20070102	02/01/2007	C	2.995,73
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES05138048N7	POP/PAG 20070115	15/01/2007	C	2.987,36
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES05138048U2	POP/PAG 20070119	19/01/2007	C	2.975,75
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES05138049E4	POP/PAG 20070206	06/02/2007	C	2.974,69
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804A18	POP/PAG 20070202	02/02/2007	C	2.986,44
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804A26	POP/PAG 20070305	05/03/2007	C	2.974,33
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804B58	POP/PAG 20070323	23/03/2007	C	2.971,68

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804D49	POP/PAG 20070413	13/04/2007	C	2.946,88
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804E89	POP/PAG 20070511	11/05/2007	C	2.946,68
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804G04	POP/PAG 20070601	01/06/2007	C	2.948,24
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804H78	POP/PAG 20070622	22/06/2007	C	2.942,19
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804I36	POP/PAG 20070629	29/06/2007	C	2.944,34
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804I44	POP/PAG 20070105	05/01/2007	C	2.984,28
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804J43	POP/PAG 20070713	13/07/2007	C	2.918,05
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804J84	POP/PAG 20071102	02/11/2007	C	2.889,33
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804J92	POP/PAG 20070831	31/08/2007	C	2.923,53
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804K81	POP/PAG 20070131	31/01/2007	C	2.983,09
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804L07	POP/PAG 20070928	28/09/2007	C	2.892,89
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804M30	POP/PAG 20070824	24/08/2007	C	2.924,42
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804M55	POP/PAG 20070903	03/09/2007	C	2.917,62
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804N47	POP/PAG 20070914	14/09/2007	C	2.919,24
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804N62	POP/PAG 20070126	26/01/2007	C	2.984,44
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804P03	POP/PAG 20070110	10/01/2007	C	2.987,25
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804P37	POP/PAG 20070104	04/01/2007	C	2.990,15
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804P45	POP/PAG 20071019	19/10/2007	C	2.894,67
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804P52	POP/PAG 20070117	17/01/2007	C	2.981,89
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804P78	POP/PAG 20070122	22/01/2007	C	2.982,35
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804Q10	POP/PAG 20071026	26/10/2007	C	2.894,38
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804Q36	POP/PAG 20071130	30/11/2007	C	2.883,70
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804Q85	POP/PAG 20071116	16/11/2007	C	2.895,50
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804R76	POP/PAG 20070130	30/01/2007	C	2.988,44
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804T09	POP/PAG 20071214	14/12/2007	C	2.893,16
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804T82	POP/PAG 20071221	21/12/2007	C	2.884,75
BANKINTER, S.A.	ES0513679AF0	BKT/PAG 20070320	20/03/2007	C	988,27
BANKINTER, S.A.	ES0513679DR9	BKT/PAG 20070420	20/04/2007	C	982,37
BANKINTER, S.A.	ES0513679DT5	BKT/PAG 20070620	20/06/2007	C	978,20
BANKINTER, S.A.	ES0513679DZ2	BKT/PAG 20070119	19/01/2007	C	993,37
BANKINTER, S.A.	ES0513679EC9	BKT/PAG 20070720	20/07/2007	C	972,49
BANKINTER, S.A.	ES0513679E16	BKT/PAG 20071212	12/12/2007	C	962,71
BANKINTER, S.A.	ES0513679EJ4	BKT/PAG 20070206	06/02/2007	C	992,34
BANKINTER, S.A.	ES0513679EL0	BKT/PAG 20070220	20/02/2007	C	992,59
BANKINTER, S.A.	ES0513679ER7	BKT/PAG 20070817	17/08/2007	C	973,67
BANKINTER, S.A.	ES0513679EW7	BKT/PAG 20080320	20/03/2008	C	950,37
BANKINTER, S.A.	ES0513679FH5	BKT/PAG 20070411	11/04/2007	C	981,23
BANKINTER, S.A.	ES0513679FM5	BKT/PAG 20070518	18/05/2007	C	983,48
BANKINTER, S.A.	ES0513679GD2	BKT/PAG 20070104	04/01/2007	C	994,98
BANKINTER, S.A.	ES0513679GL5	BKT/PAG 20070131	31/01/2007	C	992,86
BANKINTER, S.A.	ES0513679HB4	BKT/PAG 20080620	20/06/2008	C	943,07
BANKINTER, S.A.	ES0513679HD0	BKT/PAG 20070914	14/09/2007	C	965,50
BANKINTER, S.A.	ES0513679HI9	BKT/PAG 20070403	03/04/2007	C	988,33
BANKINTER, S.A.	ES0513679HJ7	BKT/PAG 20071004	04/10/2007	C	964,25
BANKINTER, S.A.	ES0513679HK5	BKT/PAG 20070410	10/04/2007	C	982,72
BANKINTER, S.A.	ES0513679HN9	BKT/PAG 20071029	29/10/2007	C	962,41
BANKINTER, S.A.	ES0513679HR0	BKT/PAG 20071108	08/11/2007	C	964,47
BANKINTER, S.A.	ES0513679HW0	BKT/PAG 20070108	08/01/2007	C	997,56
BANKINTER, S.A.	ES0513679HX8	BKT/PAG 20070111	11/01/2007	C	997,33
BANKINTER, S.A.	ES0513679HY6	BKT/PAG 20080305	05/03/2008	C	954,34
BANKINTER, S.A.	ES0513679HZ3	BKT/PAG 20070115	15/01/2007	C	997,01
BANKINTER, S.A.	ES0513679IA4	BKT/PAG 20070309	09/03/2007	C	991,18
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424087	BBK.EMPTOS/PAG 20070112	12/01/2007	C	991,46
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424095	BBK.EMPTOS/PAG 20070712	12/07/2007	C	978,95
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424103	BBK.EMPTOS/PAG 20070119	19/01/2007	C	991,01
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424129	BBK.EMPTOS/PAG 20070131	31/01/2007	C	991,11
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424194	BBK.EMPTOS/PAG 20070322	22/03/2007	C	983,17
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424202	BBK.EMPTOS/PAG 20070329	29/03/2007	C	982,43
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424210	BBK.EMPTOS/PAG 20070102	02/01/2007	C	991,57
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424228	BBK.EMPTOS/PAG 20070228	28/02/2007	C	985,69
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424236	BBK.EMPTOS/PAG 20070403	03/04/2007	C	982,34
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424251	BBK.EMPTOS/PAG 20070411	11/04/2007	C	982,02
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424269	BBK.EMPTOS/PAG 20070420	20/04/2007	C	981,93
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424277	BBK.EMPTOS/PAG 20070427	27/04/2007	C	981,73
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424301	BBK.EMPTOS/PAG 20070507	07/05/2007	C	981,56
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424327	BBK.EMPTOS/PAG 20070612	12/06/2007	C	981,44
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424335	BBK.EMPTOS/PAG 20071207	07/12/2007	C	962,81
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677XA7	BBVAF/PAG 20070104	04/01/2007	C	997,82
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677X10	BBVAF/PAG 20070110	10/01/2007	C	993,82
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677XK6	BBVAF/PAG 20070112	12/01/2007	C	993,25
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677XM2	BBVAF/PAG 20070115	15/01/2007	C	995,46
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677XN0	BBVAF/PAG 20070117	17/01/2007	C	991,82
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677XP5	BBVAF/PAG 20070119	19/01/2007	C	994,93
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677XR1	BBVAF/PAG 20070118	18/01/2007	C	993,02
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677XX9	BBVAF/PAG 20070129	29/01/2007	C	992,19
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677XZ4	BBVAF/PAG 20070124	24/01/2007	C	996,15
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677YE7	BBVAF/PAG 20070201	01/02/2007	C	994,37
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677Y18	BBVAF/PAG 20070207	07/02/2007	C	993,91
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677Y06	BBVAF/PAG 20070202	02/02/2007	C	995,35
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677YP3	BBVAF/PAG 20070209	09/02/2007	C	995,32
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677YR9	BBVAF/PAG 20070131	31/01/2007	C	989,94
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677YS7	BBVAF/PAG 20070212	12/02/2007	C	993,61
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677YT5	BBVAF/PAG 20070215	15/02/2007	C	990,67
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677ZB0	BBVAF/PAG 20070223	23/02/2007	C	991,88
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677ZD6	BBVAF/PAG 20070226	26/02/2007	C	993,55

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677ZE4	BBVAF/PAG 20070227	27/02/2007	C	990,96
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677ZG9	BBVAF/PAG 20070306	06/03/2007	C	988,05
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677ZI5	BBVAF/PAG 20070309	09/03/2007	C	991,17
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677ZK1	BBVAF/PAG 20070312	12/03/2007	C	990,66
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677ZN5	BBVAF/PAG 20070315	15/03/2007	C	985,68
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677ZP0	BBVAF/PAG 20070319	19/03/2007	C	986,09
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677ZV8	BBVAF/PAG 20070326	26/03/2007	C	988,60
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677ZW6	BBVAF/PAG 20070327	27/03/2007	C	991,18
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513677ZZ9	BBVAF/PAG 20070403	03/04/2007	C	982,24
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687030	BBVAF/PAG 20070330	30/03/2007	C	988,40
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687055	BBVAF/PAG 20070410	10/04/2007	C	982,08
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870A3	BBVAF/PAG 20070305	05/03/2007	C	991,29
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870B1	BBVAF/PAG 20070214	14/02/2007	C	993,58
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870C9	BBVAF/PAG 20070105	05/01/2007	C	996,32
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870D7	BBVAF/PAG 20070228	28/02/2007	C	989,01
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870E5	BBVAF/PAG 20070308	08/03/2007	C	988,56
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870H8	BBVAF/PAG 20070320	20/03/2007	C	989,61
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870I6	BBVAF/PAG 20070328	28/03/2007	C	991,25
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870J4	BBVAF/PAG 20070321	21/03/2007	C	991,06
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870M8	BBVAF/PAG 20070523	23/05/2007	C	982,46
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870N6	BBVAF/PAG 20070924	24/09/2007	C	970,95
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870P1	BBVAF/PAG 20070329	29/03/2007	C	983,54
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870Q9	BBVAF/PAG 20070928	28/09/2007	C	964,10
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870R7	BBVAF/PAG 20070109	09/01/2007	C	994,82
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870S5	BBVAF/PAG 20070430	30/04/2007	C	983,11
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870T3	BBVAF/PAG 20071004	04/10/2007	C	963,69
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870V9	BBVAF/PAG 20070413	13/04/2007	C	982,56
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870W7	BBVAF/PAG 20071010	10/10/2007	C	963,27
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870X5	BBVAF/PAG 20071011	11/10/2007	C	963,22
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870Y3	BBVAF/PAG 20070514	14/05/2007	C	980,26
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136870Z0	BBVAF/PAG 20071015	15/10/2007	C	963,21
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136871A7	BBVAF/PAG 20070125	25/01/2007	C	996,40
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687154	BBVAF/PAG 20070423	23/04/2007	C	982,11
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687188	BBVAF/PAG 20070219	19/02/2007	C	989,84
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687196	BBVAF/PAG 20070316	16/03/2007	C	991,48
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136871A1	BBVAF/PAG 20070417	17/04/2007	C	982,32
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136871C7	BBVAF/PAG 20070220	20/02/2007	C	992,07
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136871D5	BBVAF/PAG 20070625	25/06/2007	C	976,88
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136871E3	BBVAF/PAG 20070425	25/04/2007	C	983,82
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136871F0	BBVAF/PAG 20070725	25/07/2007	C	972,56
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136871H6	BBVAF/PAG 20071030	30/10/2007	C	962,48
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136871K0	BBVAF/PAG 20070507	07/05/2007	C	981,72
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136871N4	BBVAF/PAG 20071031	31/10/2007	C	965,54
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136871O2	BBVAF/PAG 20071112	12/11/2007	C	963,13
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136871Q7	BBVAF/PAG 20070515	15/05/2007	C	985,54
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136871R5	BBVAF/PAG 20071114	14/11/2007	C	962,53
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136871S3	BBVAF/PAG 20071116	16/11/2007	C	962,33
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136871T1	BBVAF/PAG 20071119	19/11/2007	C	962,24
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136871V7	BBVAF/PAG 20071120	20/11/2007	C	964,60
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136871Y1	BBVAF/PAG 20071122	22/11/2007	C	963,49
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136871Z8	BBVAF/PAG 20071126	26/11/2007	C	964,41
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687220	BBVAF/PAG 20070122	22/01/2007	C	995,43
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687238	BBVAF/PAG 20070427	27/04/2007	C	983,59
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687246	BBVAF/PAG 20070130	30/01/2007	C	995,35
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687279	BBVAF/PAG 20070503	03/05/2007	C	979,26
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136872A9	BBVAF/PAG 20070424	24/04/2007	C	985,59
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136872C5	BBVAF/PAG 20070724	24/07/2007	C	975,92
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136872E1	BBVAF/PAG 20071129	29/11/2007	C	963,34
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136872H4	BBVAF/PAG 20071205	05/12/2007	C	963,00
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136872J0	BBVAF/PAG 20071212	12/12/2007	C	963,90
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136872K8	BBVAF/PAG 20070213	13/02/2007	C	994,17
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136872N2	BBVAF/PAG 20071220	20/12/2007	C	962,66
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136872O0	BBVAF/PAG 20070322	22/03/2007	C	991,44
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136872P7	BBVAF/PAG 20071221	21/12/2007	C	963,51
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687378	BBVAF/PAG 20070517	17/05/2007	C	977,90
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687428	BBVAF/PAG 20070108	08/01/2007	C	993,80
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687451	BBVAF/PAG 20070531	31/05/2007	C	983,08
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687493	BBVAF/PAG 20070530	30/05/2007	C	978,14
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687550	BBVAF/PAG 20070613	13/06/2007	C	981,55
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687568	BBVAF/PAG 20070614	14/06/2007	C	981,74
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687584	BBVAF/PAG 20070102	02/01/2007	C	998,43
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687592	BBVAF/PAG 20070620	20/06/2007	C	981,16
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687618	BBVAF/PAG 20070622	22/06/2007	C	981,45
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687626	BBVAF/PAG 20070627	27/06/2007	C	981,50
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687659	BBVAF/PAG 20070116	16/01/2007	C	993,65
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687717	BBVAF/PAG 20070111	11/01/2007	C	996,42
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687758	BBVAF/PAG 20070712	12/07/2007	C	978,48
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687790	BBVAF/PAG 20070323	23/03/2007	C	990,45
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687808	BBVAF/PAG 20070420	20/04/2007	C	982,68
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687824	BBVAF/PAG 20070123	23/01/2007	C	997,49
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687832	BBVAF/PAG 20070126	26/01/2007	C	995,56
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687865	BBVAF/PAG 20070205	05/02/2007	C	989,13
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687949	BBVAF/PAG 20070103	03/01/2007	C	998,54
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXANO)	ES05149582C5	CAIXANOVA/PAG 20070122	22/01/2007	C	996,94
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840M00	CA.CATALUNYA/PAG 20070503	03/05/2007	C	48.961,26

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840M34	CA.CATALUNYA/PAG 20070510	10/05/2007	C	49.109,03
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840M67	CA.CATALUNYA/PAG 20070517	17/05/2007	C	49.081,53
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840N58	CA.CATALUNYA/PAG 20070118	18/01/2007	C	49.629,09
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840O57	CA.CATALUNYA/PAG 20070614	14/06/2007	C	49.057,89
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840O81	CA.CATALUNYA/PAG 20070621	21/06/2007	C	49.060,62
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840P23	CA.CATALUNYA/PAG 20070104	04/01/2007	C	49.563,28
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840P64	CA.CATALUNYA/PAG 20070802	02/08/2007	C	48.506,45
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840P72	CA.CATALUNYA/PAG 20070111	11/01/2007	C	49.595,41
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840Q30	CA.CATALUNYA/PAG 20070823	23/08/2007	C	48.745,75
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840R21	CA.CATALUNYA/PAG 20070301	01/03/2007	C	49.526,61
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840R47	CA.CATALUNYA/PAG 20070308	08/03/2007	C	49.546,79
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840R70	CA.CATALUNYA/PAG 20071018	18/10/2007	C	48.155,60
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840R96	CA.CATALUNYA/PAG 20070927	27/09/2007	C	48.202,44
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840S12	CA.CATALUNYA/PAG 20080327	27/03/2008	C	47.362,19
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840S20	CA.CATALUNYA/PAG 20071004	04/10/2007	C	48.169,56
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840S38	CA.CATALUNYA/PAG 20071011	11/10/2007	C	48.160,78
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840S46	CA.CATALUNYA/PAG 20070412	12/04/2007	C	49.095,88
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840S95	CA.CATALUNYA/PAG 20071213	13/12/2007	C	48.116,11
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840T03	CA.CATALUNYA/PAG 20070524	24/05/2007	C	49.203,26
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840T11	CA.CATALUNYA/PAG 20071129	29/11/2007	C	48.152,86
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840T29	CA.CATALUNYA/PAG 20071207	07/12/2007	C	48.136,53
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840T45	CA.CATALUNYA/PAG 20071220	20/12/2007	C	48.073,05
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249047	CA.GIRONA/PAG 20070228	28/02/2007	C	993,20
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249203	CA.GIRONA/PAG 20071205	05/12/2007	C	962,88
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850173	CA.MANRESA/PAG 20070104	04/01/2007	C	991,69
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850280	CA.MANRESA/PAG 20070518	18/05/2007	C	984,50
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850298	CA.MANRESA/PAG 20070618	18/06/2007	C	981,37
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850314	CA.MANRESA/PAG 20070524	24/05/2007	C	984,65
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0514973009	CA.SABADELL/PAG 20070307	07/03/2007	C	985,17
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0514973041	CA.SABADELL/PAG 20070926	26/09/2007	C	964,72
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346304	CA.TARRAGONA/PAG 20070115	15/01/2007	C	994,61
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346320	CA.TARRAGONA/PAG 20070129	29/01/2007	C	990,51
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346361	CA.TARRAGONA/PAG 20070228	28/02/2007	C	987,83
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346411	CA.TARRAGONA/PAG 20070628	28/06/2007	C	981,27
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346437	CA.TARRAGONA/PAG 20070427	27/04/2007	C	981,59
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346445	CA.TARRAGONA/PAG 20070126	26/01/2007	C	991,43
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966177	CA.PENEDES/PAG 20070117	17/01/2007	C	993,95
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966441	CA.PENEDES/PAG 20070606	06/06/2007	C	981,53
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966557	CA.PENEDES/PAG 20070201	01/02/2007	C	995,82
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966599	CA.PENEDES/PAG 20070919	19/09/2007	C	966,53
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966623	CA.PENEDES/PAG 20071003	03/10/2007	C	963,49
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966631	CA.PENEDES/PAG 20070404	04/04/2007	C	982,16
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966649	CA.PENEDES/PAG 20070418	18/04/2007	C	987,87
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966664	CA.PENEDES/PAG 20070425	25/04/2007	C	981,74
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0514966730	CA.PENEDES/PAG 20071205	05/12/2007	C	962,76
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148430C8	CAIXAGALICIA/PAG 20070601	01/06/2007	C	976,50
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148430D6	CAIXAGALICIA/PAG 20070611	11/06/2007	C	981,12
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148430E4	CAIXAGALICIA/PAG 20070615	15/06/2007	C	982,36
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148430F1	CAIXAGALICIA/PAG 20070629	29/06/2007	C	981,10
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148430H7	CAIXAGALICIA/PAG 20070706	06/07/2007	C	974,19
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148430I5	CAIXAGALICIA/PAG 20070713	13/07/2007	C	974,31
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148430K1	CAIXAGALICIA/PAG 20070726	26/07/2007	C	977,91
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148430R6	CAIXAGALICIA/PAG 20070920	20/09/2007	C	964,62
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148430T2	CAIXAGALICIA/PAG 20071003	03/10/2007	C	963,74
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148430U0	CAIXAGALICIA/PAG 20071011	11/10/2007	C	963,92
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148430V8	CAIXAGALICIA/PAG 20071026	26/10/2007	C	962,48
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148430W6	CAIXAGALICIA/PAG 20071029	29/10/2007	C	963,70
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148430Y2	CAIXAGALICIA/PAG 20071116	16/11/2007	C	962,45
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431B8	CAIXAGALICIA/PAG 20071205	05/12/2007	C	963,09
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431C6	CAIXAGALICIA/PAG 20071219	19/12/2007	C	961,50
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0514843814	CAIXAGALICIA/PAG 20070108	08/01/2007	C	996,85
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0514843822	CAIXAGALICIA/PAG 20070122	22/01/2007	C	994,74
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0514843889	CAIXAGALICIA/PAG 20070228	28/02/2007	C	986,61
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0514843905	CAIXAGALICIA/PAG 20070305	05/03/2007	C	987,92
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0514843913	CAIXAGALICIA/PAG 20070314	14/03/2007	C	988,20
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0514843921	CAIXAGALICIA/PAG 20070330	30/03/2007	C	982,32
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0514843939	CAIXAGALICIA/PAG 20070403	03/04/2007	C	982,98
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0514843947	CAIXAGALICIA/PAG 20070419	19/04/2007	C	982,08
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0514843970	CAIXAGALICIA/PAG 20070504	04/05/2007	C	979,12
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0514843988	CAIXAGALICIA/PAG 20070511	11/05/2007	C	982,43
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148450C6	CAI/PAG 20070327	27/03/2007	C	98.257,15
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148450D4	CAI/PAG 20070410	10/04/2007	C	98.200,95
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148450H5	CAI/PAG 20070620	20/06/2007	C	98.119,79
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155300A7	CA.RIOJA/PAG 20070406	06/04/2007	C	98.211,09
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES0515530964	CA.RIOJA/PAG 20070105	05/01/2007	C	99.133,47
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146001G0	CA.MURCIA/PAG 20070105	05/01/2007	C	994,55
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146001H8	CA.MURCIA/PAG 20070119	19/01/2007	C	993,77
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146001W7	CA.MURCIA/PAG 20070326	26/03/2007	C	987,68
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146001X5	CA.MURCIA/PAG 20070129	29/01/2007	C	990,13
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148541H1	CAJADUERO/PAG 20070208	08/02/2007	C	993,43
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148542L1	CAJADUERO/PAG 20070404	04/04/2007	C	982,52
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148542X6	CAJADUERO/PAG 20070427	27/04/2007	C	981,61
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148543E4	CAJADUERO/PAG 20070524	24/05/2007	C	980,85
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148543O3	CAJADUERO/PAG 20070105	05/01/2007	C	991,01
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148543W6	CAJADUERO/PAG 20070131	31/01/2007	C	991,26

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148544A0	CAJADUERO/PAG 20070823	23/08/2007	C	968,27
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148544C6	CAJADUERO/PAG 20070727	27/07/2007	C	972,11
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148544D4	CAJADUERO/PAG 20070315	15/03/2007	C	984,02
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148544I3	CAJADUERO/PAG 20070322	22/03/2007	C	985,20
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148544J1	CAJADUERO/PAG 20070108	08/01/2007	C	990,53
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148544K9	CAJADUERO/PAG 20070330	30/03/2007	C	982,59
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148544L7	CAJADUERO/PAG 20070115	15/01/2007	C	993,37
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148544M5	CAJADUERO/PAG 20070403	03/04/2007	C	982,31
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148544O1	CAJADUERO/PAG 20070706	06/07/2007	C	972,82
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148544P8	CAJADUERO/PAG 20070410	10/04/2007	C	982,30
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148544Q6	CAJADUERO/PAG 20071015	15/10/2007	C	964,02
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148544S2	CAJADUERO/PAG 20070130	30/01/2007	C	990,46
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148545D1	CAJADUERO/PAG 20070604	04/06/2007	C	984,23
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149752E0	CA.CANTABRIA/PAG 20070301	01/03/2007	C	9.907,48
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149752L5	CA.CANTABRIA/PAG 20070412	12/04/2007	C	9.818,41
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149752M3	CA.CANTABRIA/PAG 20070122	22/01/2007	C	9.934,50
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149752Y8	CA.CANTABRIA/PAG 20070313	13/03/2007	C	9.874,83
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149753A6	CA.CANTABRIA/PAG 20070927	27/09/2007	C	9.641,96
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149753D0	CA.CANTABRIA/PAG 20070716	16/07/2007	C	9.725,28
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149753E8	CA.CANTABRIA/PAG 20070109	09/01/2007	C	9.968,88
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149753L3	CA.CANTABRIA/PAG 20070517	17/05/2007	C	9.816,19
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149753N9	CA.CANTABRIA/PAG 20071128	28/11/2007	C	9.631,56
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149775S1	BANCAJA/PAG 20070510	10/05/2007	C	982,20
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149775Z6	BANCAJA/PAG 20070223	23/02/2007	C	991,11
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149776B5	BANCAJA/PAG 20070125	25/01/2007	C	991,11
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149776E9	BANCAJA/PAG 20070110	10/01/2007	C	991,31
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149776F6	BANCAJA/PAG 20070525	25/05/2007	C	981,18
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149776I0	BANCAJA/PAG 20070608	08/06/2007	C	983,12
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149776J8	BANCAJA/PAG 20070209	09/02/2007	C	993,10
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149776M2	BANCAJA/PAG 20070625	25/06/2007	C	981,13
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149776S9	BANCAJA/PAG 20070117	17/01/2007	C	991,40
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149776T7	BANCAJA/PAG 20070425	25/04/2007	C	982,30
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149776V3	BANCAJA/PAG 20070131	31/01/2007	C	991,98
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149777H0	BANCAJA/PAG 20070410	10/04/2007	C	982,10
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149777N8	BANCAJA/PAG 20071010	10/10/2007	C	964,19
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149777O6	BANCAJA/PAG 20071025	25/10/2007	C	964,14
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149777P3	BANCAJA/PAG 20071026	26/10/2007	C	963,94
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149777S7	BANCAJA/PAG 20071031	31/10/2007	C	964,22
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149777T5	BANCAJA/PAG 20071109	09/11/2007	C	964,25
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149777Y5	BANCAJA/PAG 20071210	10/12/2007	C	962,69
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCA.	ES05149777Z2	BANCAJA/PAG 20071205	05/12/2007	C	962,93
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144003X3	CAM/PAG 20070118	18/01/2007	C	993,74
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144003Z8	CAM/PAG 20070201	01/02/2007	C	993,75
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144004N2	CAM/PAG 20070426	26/04/2007	C	987,76
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144005G3	CAM/PAG 20070405	05/04/2007	C	987,11
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144005H1	CAM/PAG 20070927	27/09/2007	C	964,93
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144005Q2	CAM/PAG 20071213	13/12/2007	C	961,92
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144005R0	CAM/PAG 20071220	20/12/2007	C	961,34
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149611W0	CA.BURGOS/PAG 20070201	01/02/2007	C	992,33
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149612G1	CA.BURGOS/PAG 20070917	17/09/2007	C	965,57
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149612J5	CA.BURGOS/PAG 20071001	01/10/2007	C	965,10
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149612M9	CA.BURGOS/PAG 20071217	17/12/2007	C	961,67
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149612N7	CA.BURGOS/PAG 20070615	15/06/2007	C	978,38
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149612S6	CA.BURGOS/PAG 20080616	16/06/2008	C	943,86
CAJA DE AHORROS PROVINCIAL SAN FERNANDO DE SEVILLA Y JER	ES05149692G3	CA.SAN.FERN/PAG 20070104	04/01/2007	C	99.692,65
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES05149265I0	SA.NOSTRA/PAG 20070313	13/03/2007	C	98.829,73
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES05149265J9	SA.NOSTRA/PAG 20070109	09/01/2007	C	99.224,90
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0564730267	CAJASUR/PAG 20070202	02/02/2007	C	99.356,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0564730358	CAJASUR/PAG 20070330	30/03/2007	C	98.434,66
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0564730382	CAJASUR/PAG 20070410	10/04/2007	C	98.200,95
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0564730515	CAJASUR/PAG 20070215	15/02/2007	C	98.697,47
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0564730531	CAJASUR/PAG 20070402	02/04/2007	C	98.229,90
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0564730549	CAJASUR/PAG 20070105	05/01/2007	C	99.102,38
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0564730556	CAJASUR/PAG 20071003	03/10/2007	C	96.348,73
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0564730564	CAJASUR/PAG 20071012	12/10/2007	C	96.310,10
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149653P6	CAN/PAG 20070109	09/01/2007	C	99.329,12
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149653T8	CAN/PAG 20070116	16/01/2007	C	99.229,48
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149654D0	CAN/PAG 20070227	27/02/2007	C	98.582,60
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149654L3	CAN/PAG 20070403	03/04/2007	C	98.230,79
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149654Z3	CAN/PAG 20070102	02/01/2007	C	99.141,07
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149655A3	CAN/PAG 20070626	26/06/2007	C	97.346,44
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149655D7	CAN/PAG 20070220	20/02/2007	C	99.458,45
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149655H8	CAN/PAG 20070918	18/09/2007	C	96.558,28
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149655J4	CAN/PAG 20070925	25/09/2007	C	96.447,62
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149655K2	CAN/PAG 20071002	02/10/2007	C	96.358,39
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149655M8	CAN/PAG 20070410	10/04/2007	C	98.226,96
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149655N6	CAN/PAG 20071009	09/10/2007	C	96.339,05
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149655Q9	CAN/PAG 20070515	15/05/2007	C	98.182,35
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149655R7	CAN/PAG 20071113	13/11/2007	C	96.267,66
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149655T3	CAN/PAG 20071120	20/11/2007	C	96.266,19
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149655Y3	CAN/PAG 20071218	18/12/2007	C	96.154,68
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149655Z0	CAN/PAG 20070619	19/06/2007	C	98.123,65
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO CATOLICO	ES0515134544	CAJACIRCULO/PAG 20070410	10/04/2007	C	98.200,97
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO CATOLICO	ES0515134585	CAJACIRCULO/PAG 20070925	25/09/2007	C	96.674,83
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO CATOLICO	ES0515134619	CAJACIRCULO/PAG 20070612	12/06/2007	C	98.103,64

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO CATOLICO	ES0515134627	CAJACIRCULO/PAG 20071204	04/12/2007	C	96.307,64
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149704D3	LA.CAIXA/PAG 20070102	02/01/2007	C	993,68
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149704E1	LA.CAIXA/PAG 20070109	09/01/2007	C	994,47
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149704I2	LA.CAIXA/PAG 20070123	23/01/2007	C	993,64
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149704K8	LA.CAIXA/PAG 20070206	06/02/2007	C	988,63
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149704P7	LA.CAIXA/PAG 20070220	20/02/2007	C	992,39
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149704W3	LA.CAIXA/PAG 20070320	20/03/2007	C	984,78
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149705A6	LA.CAIXA/PAG 20070327	27/03/2007	C	985,56
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149705B4	LA.CAIXA/PAG 20070403	03/04/2007	C	982,48
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149705E8	LA.CAIXA/PAG 20070417	17/04/2007	C	985,04
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149705F5	LA.CAIXA/PAG 20070419	19/04/2007	C	986,46
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149705L3	LA.CAIXA/PAG 20070508	08/05/2007	C	985,71
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149705O7	LA.CAIXA/PAG 20070515	15/05/2007	C	979,23
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149705S8	LA.CAIXA/PAG 20070313	13/03/2007	C	985,17
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149705Z3	LA.CAIXA/PAG 20070615	15/06/2007	C	975,44
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149706B2	LA.CAIXA/PAG 20070619	19/06/2007	C	979,52
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149706H9	LA.CAIXA/PAG 20070626	26/06/2007	C	978,21
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149706U2	LA.CAIXA/PAG 20070717	17/07/2007	C	976,36
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149707E4	LA.CAIXA/PAG 20070807	07/08/2007	C	976,06
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149707N5	LA.CAIXA/PAG 20070410	10/04/2007	C	988,07
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149708C6	LA.CAIXA/PAG 20070911	11/09/2007	C	966,44
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149708I3	LA.CAIXA/PAG 20071204	04/12/2007	C	963,19
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149708J1	LA.CAIXA/PAG 20071009	09/10/2007	C	966,29
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149708O1	LA.CAIXA/PAG 20070105	05/01/2007	C	996,09
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149708V6	LA.CAIXA/PAG 20070205	05/02/2007	C	992,03
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149708Y0	LA.CAIXA/PAG 20071218	18/12/2007	C	961,73
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES05149709J9	LA.CAIXA/PAG 20071127	27/11/2007	C	963,41
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE P	ES05154740C1	CA.ESPAÑA/PAG 20070105	05/01/2007	C	9.911,25
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE P	ES05154740E7	CA.ESPAÑA/PAG 20070112	12/01/2007	C	9.911,03
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE P	ES05154740K4	CA.ESPAÑA/PAG 20070320	20/03/2007	C	9.836,86
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE P	ES05154741B1	CA.ESPAÑA/PAG 20070403	03/04/2007	C	9.822,73
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE P	ES05154741C9	CA.ESPAÑA/PAG 20070228	28/02/2007	C	9.857,35
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE P	ES05154741I6	CA.ESPAÑA/PAG 20070116	16/01/2007	C	9.940,49
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE P	ES05154741N6	CA.ESPAÑA/PAG 20071207	07/12/2007	C	9.627,68
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE P	ES0515474874	CA.ESPAÑA/PAG 20070330	30/03/2007	C	9.825,95
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE P	ES0515474924	CA.ESPAÑA/PAG 20070410	10/04/2007	C	9.824,89
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE P	ES0515474981	CA.ESPAÑA/PAG 20070531	31/05/2007	C	9.832,05
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0514981MA5	CAJACANARIAS/PAG 20070105	05/01/2007	C	996,56
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0514981OA1	CAJACANARIAS/PAG 20070330	30/03/2007	C	983,05
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0514981PM3	CAJACANARIAS/PAG 20070622	22/06/2007	C	981,06
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES05149820Q9	CA.GRANADA/PAG 20070119	19/01/2007	C	99.057,28
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES05149820T3	CA.GRANADA/PAG 20070404	04/04/2007	C	98.214,16
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES05149820U1	CA.GRANADA/PAG 20070305	05/03/2007	C	98.520,72
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES05149820V9	CA.GRANADA/PAG 20070420	20/04/2007	C	98.223,66
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153062T5	CR.NAVARRA/PAG 20070110	10/01/2007	C	9.972,74
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153062U3	CR.NAVARRA/PAG 20070124	24/01/2007	C	9.974,46
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153062W9	CR.NAVARRA/PAG 20070131	31/01/2007	C	9.966,90
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153063K2	CR.NAVARRA/PAG 20070418	18/04/2007	C	9.875,27
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153064L8	CR.NAVARRA/PAG 20071003	03/10/2007	C	9.649,72
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153064M6	CR.NAVARRA/PAG 20070117	17/01/2007	C	9.926,04
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153064N4	CR.NAVARRA/PAG 20071010	10/10/2007	C	9.634,15
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153064R5	CR.NAVARRA/PAG 20071114	14/11/2007	C	9.637,66
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153064S3	CR.NAVARRA/PAG 20070502	02/05/2007	C	9.842,83
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153064T1	CR.NAVARRA/PAG 20071121	21/11/2007	C	9.628,48
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153064W5	CR.NAVARRA/PAG 20071219	19/12/2007	C	9.630,70
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO	ES0567960564	CORP.ANDINA/PAG 20070110	10/01/2007	C	99.277,45
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991167	ELE.CAP/PAG 20070110	10/01/2007	C	991,74
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991225	ELE.CAP/PAG 20070606	06/06/2007	C	982,94
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991233	ELE.CAP/PAG 20070620	20/06/2007	C	982,21
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991290	ELE.CAP/PAG 20070117	17/01/2007	C	997,21
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991332	ELE.CAP/PAG 20070404	04/04/2007	C	982,06
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991357	ELE.CAP/PAG 20070411	11/04/2007	C	982,06
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991365	ELE.CAP/PAG 20071010	10/10/2007	C	966,63
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991373	ELE.CAP/PAG 20070124	24/01/2007	C	991,17
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991381	ELE.CAP/PAG 20070425	25/04/2007	C	982,94
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991399	ELE.CAP/PAG 20071024	24/10/2007	C	966,37
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991472	ELE.CAP/PAG 20070221	21/02/2007	C	991,36
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991498	ELE.CAP/PAG 20070307	07/03/2007	C	991,92
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991506	ELE.CAP/PAG 20071205	05/12/2007	C	964,79
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991514	ELE.CAP/PAG 20070321	21/03/2007	C	991,40
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0530991530	ELE.CAP/PAG 20071219	19/12/2007	C	962,12
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER I	ES0515225V84	FTA.SAN.I/PAG 20070116	16/01/2007	C	99.153,08
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES0506025610	HIDROCANTABRICO/PAG 20070315	15/03/2007	C	984,06
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES0506025669	HIDROCANTABRICO/PAG 20070515	15/05/2007	C	984,99
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES0506025685	HIDROCANTABRICO/PAG 20070330	30/03/2007	C	984,34
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES0506025693	HIDROCANTABRICO/PAG 20070928	28/09/2007	C	966,23
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES0506025719	HIDROCANTABRICO/PAG 20070402	02/04/2007	C	196.466,37
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES0506025727	HIDROCANTABRICO/PAG 20070416	16/04/2007	C	982,01
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES0506025743	HIDROCANTABRICO/PAG 20071016	16/10/2007	C	963,21
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES0506025776	HIDROCANTABRICO/PAG 20070430	30/04/2007	C	982,93
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES0506025826	HIDROCANTABRICO/PAG 20071130	30/11/2007	C	963,64
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES0506025834	HIDROCANTABRICO/PAG 20071203	03/12/2007	C	192.701,53
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES0506025842	HIDROCANTABRICO/PAG 20071214	14/12/2007	C	961,92
IBERDROLA, S.A.	ES0544580AL1	IBE/PAG 20070308	08/03/2007	C	993,22
IBERDROLA, S.A.	ES0544580AP2	IBE/PAG 20071004	04/10/2007	C	963,56

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
IBERDROLA, S.A.	ES0544580AQ0	IBE/PAG 20070412	12/04/2007	C	982,12
IBERDROLA, S.A.	ES0544580AR8	IBE/PAG 20071011	11/10/2007	C	963,42
IBERDROLA, S.A.	ES0544580AV0	IBE/PAG 20071025	25/10/2007	C	962,63
IBERDROLA, S.A.	ES0544580AW8	IBE/PAG 20071115	15/11/2007	C	965,49
IBERDROLA, S.A.	ES0544580AX6	IBE/PAG 20070611	11/06/2007	C	981,43
IBERDROLA, S.A.	ES0544580AY4	IBE/PAG 20071220	20/12/2007	C	961,60
IBERDROLA, S.A.	ES0544580W66	IBE/PAG 20070111	11/01/2007	C	992,27
IBERDROLA, S.A.	ES0544580X08	IBE/PAG 20070118	18/01/2007	C	996,93
IBERDROLA, S.A.	ES0544580X16	IBE/PAG 20070125	25/01/2007	C	997,19
IBERDROLA, S.A.	ES0544580X40	IBE/PAG 20070208	08/02/2007	C	990,60
IBERDROLA, S.A.	ES0544580X65	IBE/PAG 20070215	15/02/2007	C	991,27
IBERDROLA, S.A.	ES0544580Y72	IBE/PAG 20070322	22/03/2007	C	990,86
IBERDROLA, S.A.	ES0544580Z30	IBE/PAG 20070503	03/05/2007	C	986,41
IBERDROLA, S.A.	ES0544580Z48	IBE/PAG 20070510	10/05/2007	C	982,34
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE CREDITO	ES05176171F6	LICO.LEASING/PAG 20070404	04/04/2007	C	98.225,89
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE CREDITO	ES05176171X9	LICO.LEASING/PAG 20071009	09/10/2007	C	96.346,85
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE CREDITO	ES05176171Y7	LICO.LEASING/PAG 20070410	10/04/2007	C	98.207,17
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE HUELVA Y SEVILLA	ES05171569R1	EL.MONTE/PAG 20070622	22/06/2007	C	49.052,36
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE HUELVA Y SEVILLA	ES0517156A47	EL.MONTE/PAG 20071207	07/12/2007	C	48.136,07
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, ALME	ES0564872014	UNICAJA/PAG 20070105	05/01/2007	C	99.666,57
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, ALME	ES05648720J2	UNICAJA/PAG 20070122	22/01/2007	C	99.485,12
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, ALME	ES05648720L8	UNICAJA/PAG 20070220	20/02/2007	C	99.158,77
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, ALME	ES05648720N4	UNICAJA/PAG 20070320	20/03/2007	C	98.354,69
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, ALME	ES05648720O2	UNICAJA/PAG 20070404	04/04/2007	C	98.209,77
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, ALME	ES05648720P9	UNICAJA/PAG 20070420	20/04/2007	C	98.194,98
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, ALME	ES05648720X3	UNICAJA/PAG 20070820	20/08/2007	C	97.205,45
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, ALME	ES05648720Z8	UNICAJA/PAG 20070920	20/09/2007	C	96.477,88
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, ALME	ES05648721D3	UNICAJA/PAG 20071120	20/11/2007	C	96.399,27
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, ALME	ES05648721F8	UNICAJA/PAG 20080305	05/03/2008	C	95.394,58
RED ELECTRICA DE ESPAÑA, S.A.	ES0573093H56	REE/PAG 20070115	15/01/2007	C	991,61
RED ELECTRICA DE ESPAÑA, S.A.	ES0573093I06	REE/PAG 20070228	28/02/2007	C	992,90
RED ELECTRICA DE ESPAÑA, S.A.	ES0573093I89	REE/PAG 20070330	30/03/2007	C	982,41
RED ELECTRICA DE ESPAÑA, S.A.	ES0573093J05	REE/PAG 20070629	29/06/2007	C	981,08
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828707N3	SYV/PAG 20070110	10/01/2007	C	991,53
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828707O1	SYV/PAG 20070124	24/01/2007	C	991,12
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828707P8	SYV/PAG 20070207	07/02/2007	C	994,15
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828707Q6	SYV/PAG 20070221	21/02/2007	C	991,98
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828707S2	SYV/PAG 20070307	07/03/2007	C	992,17
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828707T0	SYV/PAG 20070321	21/03/2007	C	988,01
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828707U8	SYV/PAG 20070404	04/04/2007	C	983,19
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828707V6	SYV/PAG 20070418	18/04/2007	C	985,65
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828707W4	SYV/PAG 20070509	09/05/2007	C	982,16
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828707Y0	SYV/PAG 20070523	23/05/2007	C	981,54
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828707Z7	SYV/PAG 20070606	06/06/2007	C	982,69
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828708A8	SYV/PAG 20070620	20/06/2007	C	977,57
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828708B6	SYV/PAG 20070704	04/07/2007	C	977,84
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828708C4	SYV/PAG 20070718	18/07/2007	C	975,99
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828708G5	SYV/PAG 20070822	22/08/2007	C	975,32
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828708H3	SYV/PAG 20070905	05/09/2007	C	974,53
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828708J9	SYV/PAG 20070919	19/09/2007	C	967,45
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828708K7	SYV/PAG 20071010	10/10/2007	C	964,32
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828708L5	SYV/PAG 20071024	24/10/2007	C	964,84
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828708M3	SYV/PAG 20071107	07/11/2007	C	964,26
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES05828708O9	SYV/PAG 20070719	19/07/2007	C	978,29
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495K85	SAN.CONS.FIN/PAG 20070105	05/01/2007	C	995,93
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495L35	SAN.CONS.FIN/PAG 20070112	12/01/2007	C	997,12
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495L43	SAN.CONS.FIN/PAG 20070119	19/01/2007	C	994,24
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495L68	SAN.CONS.FIN/PAG 20070126	26/01/2007	C	996,41
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495L76	SAN.CONS.FIN/PAG 20070202	02/02/2007	C	992,08
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495L92	SAN.CONS.FIN/PAG 20070209	09/02/2007	C	991,24
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495M18	SAN.CONS.FIN/PAG 20070216	16/02/2007	C	993,79
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495M34	SAN.CONS.FIN/PAG 20070223	23/02/2007	C	993,11
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495M42	SAN.CONS.FIN/PAG 20070302	02/03/2007	C	993,73
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495M67	SAN.CONS.FIN/PAG 20070316	16/03/2007	C	991,24
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495M75	SAN.CONS.FIN/PAG 20070323	23/03/2007	C	991,08
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495M83	SAN.CONS.FIN/PAG 20070330	30/03/2007	C	990,83
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495N17	SAN.CONS.FIN/PAG 20070504	04/05/2007	C	982,83
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495N58	SAN.CONS.FIN/PAG 20070525	25/05/2007	C	982,08
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495O08	SAN.CONS.FIN/PAG 20070608	08/06/2007	C	976,73
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495O24	SAN.CONS.FIN/PAG 20070615	15/06/2007	C	981,99
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495O40	SAN.CONS.FIN/PAG 20070622	22/06/2007	C	981,92
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495O65	SAN.CONS.FIN/PAG 20070629	29/06/2007	C	981,43
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495P23	SAN.CONS.FIN/PAG 20071221	21/12/2007	C	962,26
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495P31	SAN.CONS.FIN/PAG 20071228	28/12/2007	C	960,67
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Q06	SAN.CONS.FIN/PAG 20070727	27/07/2007	C	972,17
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Q63	SAN.CONS.FIN/PAG 20070817	17/08/2007	C	972,12
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495R96	SAN.CONS.FIN/PAG 20070928	28/09/2007	C	965,34
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495S20	SAN.CONS.FIN/PAG 20071005	05/10/2007	C	964,69
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495S46	SAN.CONS.FIN/PAG 20071019	19/10/2007	C	963,48
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495S61	SAN.CONS.FIN/PAG 20071026	26/10/2007	C	964,21
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495S87	SAN.CONS.FIN/PAG 20071102	02/11/2007	C	962,96
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495T03	SAN.CONS.FIN/PAG 20071116	16/11/2007	C	963,76
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495T37	SAN.CONS.FIN/PAG 20071123	23/11/2007	C	964,06
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495T52	SAN.CONS.FIN/PAG 20071130	30/11/2007	C	963,29
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495V41	SAN.CONS.FIN/PAG 20071029	29/10/2007	C	962,16

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495V58	SAN.CONS.FIN/PAG 20080509	09/05/2008	C	946,92
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495V90	SAN.CONS.FIN/PAG 20090116	16/01/2009	C	924,37
TELEFONICA, S.A.	ES0578430AX3	TEF/PAG 20070208	08/02/2007	C	993,72
TELEFONICA, S.A.	ES0578430BF8	TEF/PAG 20070322	22/03/2007	C	985,86
TELEFONICA, S.A.	ES0578430BJ0	TEF/PAG 20070419	19/04/2007	C	982,71
TELEFONICA, S.A.	ES0578430BR3	TEF/PAG 20070607	07/06/2007	C	981,86
TELEFONICA, S.A.	ES0578430BX1	TEF/PAG 20070104	04/01/2007	C	993,24
TELEFONICA, S.A.	ES0578430BY9	TEF/PAG 20070705	05/07/2007	C	970,10
TELEFONICA, S.A.	ES0578430BZ6	TEF/PAG 20070118	18/01/2007	C	996,78
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CC3	TEF/PAG 20070201	01/02/2007	C	993,25
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CE9	TEF/PAG 20070906	06/09/2007	C	967,20
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CF6	TEF/PAG 20070920	20/09/2007	C	967,24
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CG4	TEF/PAG 20070412	12/04/2007	C	982,84
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CH2	TEF/PAG 20071004	04/10/2007	C	966,04
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CI0	TEF/PAG 20071018	18/10/2007	C	968,12
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CL4	TEF/PAG 20071102	02/11/2007	C	964,97
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CM2	TEF/PAG 20070503	03/05/2007	C	983,64
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CO8	TEF/PAG 20070215	15/02/2007	C	994,24
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CP5	TEF/PAG 20070517	17/05/2007	C	983,02
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CQ3	TEF/PAG 20071115	15/11/2007	C	964,56
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CS9	TEF/PAG 20070524	24/05/2007	C	98.259,91
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CT7	TEF/PAG 20070719	19/07/2007	C	97.787,89
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CU5	TEF/PAG 20071115	15/11/2007	C	96.346,59
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CW1	TEF/PAG 20070531	31/05/2007	C	982,79
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CX9	TEF/PAG 20071129	29/11/2007	C	965,12
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CY7	TEF/PAG 20080110	10/01/2008	C	95.914,09
TELEFONICA, S.A.	ES0578430CZ4	TEF/PAG 20070614	14/06/2007	C	982,22
TELEFONICA, S.A.	ES0578430DA5	TEF/PAG 20071213	13/12/2007	C	964,04
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380DV3	UNF/PAG 20070326	26/03/2007	C	987,90
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380EC1	UNF/PAG 20071205	05/12/2007	C	958,81
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380EF4	UNF/PAG 20070115	15/01/2007	C	991,96
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380EI8	UNF/PAG 20070205	05/02/2007	C	990,73
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380EM0	UNF/PAG 20070215	15/02/2007	C	991,82
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380EX7	UNF/PAG 20070525	25/05/2007	C	982,82
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380FE4	UNF/PAG 20071005	05/10/2007	C	964,01
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380FF1	UNF/PAG 20070416	16/04/2007	C	981,96
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380FG9	UNF/PAG 20071015	15/10/2007	C	963,28
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380FH7	UNF/PAG 20070125	25/01/2007	C	993,49
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380FI5	UNF/PAG 20071029	29/10/2007	C	963,19
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380FM7	UNF/PAG 20071126	26/11/2007	C	964,09
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380FN5	UNF/PAG 20080305	05/03/2008	C	954,21
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380FO3	UNF/PAG 20070626	26/06/2007	C	980,70
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380FP0	UNF/PAG 20080625	25/06/2008	C	943,10

RENTA FIJA**PARTICIPACIONES PREFERENTES**

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
BANCAJA EUROCAPITAL FINANCE	KYG0727Q1073	BANCAJA.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	600,15
BANCAJA EUROCAPITAL FINANCE	KYG0727Q1156	BANCAJA.FIN/VAR NACU AMTB PPR B		V	600,41
BANESTO PREFERENTES, S.A.	ES0113772000	BTO.PREF/VAR NACU AMTB PPR I		V	24,88
BANKINTER EMISIONES, S.A.	ES0113549002	BKT.EM/VAR NACU AMTB PPR I		V	49,19
BANKINTER EMISIONES, S.A.	ES0113549028	BKT.EM/VAR NACU AMTB PPR II		V	49,32
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224001	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	100,34
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224027	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR B		V	100,40
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224043	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR C		V	100,40
BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA INTERNATIONAL LTD.	KYG090001036	BBVA.INTL/VAR NACU AMTB PPR E		V	100,40
BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA INTERNATIONAL LTD.	KYG090001119	BBVA.INTL/VAR NACU AMTB PPR F		V	100,38
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL	KYG1280W1015	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.003,99
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL	KYG717151099	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.004,88
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL	KYG717151172	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.004,76
BVA PREFERENTES, S.A.	ES0115006001	BVA.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	50.140,85
CAIXA CATALUNYA PREFERENTS, S.A.	KYG175431025	CA.CAT.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.004,50
CAIXA CATALUNYA PREFERENTS, S.A.	KYG175431108	CA.CAT.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.004,45
CAIXA DE MANLLEU PREFERENTS, S.A.	ES0115328009	CA.MANLLEU.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	500,56
CAIXA GALICIA PREFERENTES, S.A., SOCIEDAD UNIPERSONAL	ES0112805009	CA.GALICIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	563,32
CAIXA LAIETANA SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFERENTS, S.A.	ES0113251005	LAIETANA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	50.000,28
CAIXA LAIETANA SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFERENTS, S.A.	KYG1754W1087	LAIETANA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.003,37
CAIXA MANRESA PREFERENTS, S.A.	ES0115211007	CA.MANRESA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	100,13
CAIXA PENEDES CAPITAL, S.A. SOCIEDAD UNIPERSONAL	KYG1755N1079	CA.PENEDES.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.004,41
CAIXA PREFERENCE, S.A.	KYG175471039	CAIXA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.004,25
CAIXA PREFERENCE, S.A.	KYG175471112	CAIXA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.005,49
CAIXA TERRASSA, SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFERENTS, S.A.	KYG175491094	TERRASSA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.004,11
CAIXANOVA EMISIONES, S.A.	ES0169075001	CAIXANOVA.EM/VAR NACU AMTB PPR A		V	60,19
CAIXASABADELL PREFERENTS, S.A.	ES0101339002	CAIXASAB.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.003,85
CAIXASABADELL PREFERENTS, S.A.	ES0101339028	CAIXASAB.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	50.308,81
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON Y	ES0114954003	IBERCAJA/VAR NACU AMTB PPR 1*		V	49.854,39
CAJA DE AVILA PREFERENTES, S.A.	ES0122707005	CA.AVILA.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	1.006,16
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SOCIEDAD DE PARTICIPACIONES F	ES0115372007	CA.ESPAÑA.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.000,07
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SOCIEDAD DE PARTICIPACIONES F	KYG175521031	CA.ESPAÑA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B	19/01/2007	V	1.000,44
CAJA MADRID FINANCE PREFERED	ES0115373005	CA.MAD.FIN.PREF/VAR NACU AMTB PPR I		V	97,77
CAJA RIOJA PREFERENTES, S.A.	ES0113698007	CA.RIOJA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	503,83
CAJA SAN FERNANDO PREFERENCE LIMITED	KYG1755U1195	CA.SAN.FER.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	301,71
CAJAMURCIA FINANCE, S.A.	KYG175552051	CAJAMURCIA.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	501,93
CAJAMURCIA PREFERENTES, S.A. UNIPERSONAL	ES0114818000	CAJAMURCIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	504,65
CAJASUR SOCIEDAD DE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.U.	KYG1755M1096	CAJASUR.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	602,55
CAM CAPITAL	KYG1793R1020	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	602,50
CAM CAPITAL	KYG1793R1103	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR B		V	602,38
CANTABRIA CAPITAL LIMITED	KYG1825G1082	CANTABRIA.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	601,91
CANTABRIA PREFERENTES, S.A. SOCIEDAD UNIPERSONAL	ES0182834004	CANTABRIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR I		V	1.004,10
CANTABRIA PREFERENTES, S.A. SOCIEDAD UNIPERSONAL	ES0182834020	CANTABRIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR 2		V	1.004,81
CCM DE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A., SOCIEDAD UNIPER	ES0116977002	CCM.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	602,63
CCM PREFERENCE LIMITED	KYG1984E1180	CCM.PREF.LTD/VAR NACU AMTB PPR A		V	602,62
EL MONTE INTERNATIONAL CAPITAL LIMITED	KYG3014M1024	MONTE.INTL.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	502,07
EL MONTE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.	ES0128469006	EL.MONTE.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.005,02
ENDESA CAPITAL FINANCE, LLC.	USU291871080	ELE.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR		V	24,63
GALLEGO PREFERENTES, S.A.U.	ES0170234001	GALLEGO.PREF/VAR NACU AMTB PPR 1		V	50.000,00
GALLEGO PREFERENTES, S.A.U.	ES0170234027	GALLEGO.PREF/VAR NACU AMTB PPR 2		V	49.877,76
GUIPUZCOANO CAPITAL, S.A.	ES0143561001	GUI.CAP/VAR NACU AMTB PPR I		V	100,00
LA CAJA DE CANARIAS PREFERENTES, S.A.	ES0156844005	LA.CAJA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	502,33
REPSOL INTERNATIONAL CAPITAL LIMITED	KYG7513K1379	REP.INTL.CAP/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.004,02
REPSOL INTERNATIONAL CAPITAL LIMITED	KYG7513K1452	REP.INTL.CAP/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.004,66
SA NOSTRA PREFERENCE LIMITED	KYG7803W1069	SA.NOSTRA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.003,14
SABADELL INTERNATIONAL EQUITY, LTD	KYG773751063	SAB.INTL.EQ/VAR NACU AMTB PPR A		V	501,91
SANTANDER FINANCE CAPITAL, S.A. UNIPERSONAL	ES0175179003	SAN.FIN.CAP/VAR NACU AMTB PPR I		V	24,96
SANTANDER FINANCE CAPITAL, S.A. UNIPERSONAL	ES0175179029	SAN.FIN.CAP/VAR NACU AMTB PPR II		V	24,97
SANTANDER FINANCE CAPITAL, S.A. UNIPERSONAL	ES0175179045	SAN.FIN.CAP/VAR NACU AMTB PPR III		V	24,97
SANTANDER FINANCE CAPITAL, S.A. UNIPERSONAL	ES0175179052	SAN.FIN.CAP/VAR NACU AMTB PPR IV		V	24,96
SANTANDER FINANCE CAPITAL, S.A. UNIPERSONAL	ES0175179060	SAN.FIN.CAP/VAR NACU AMTB PPR V		V	24,97
SOL MELIA FINANCE LIMITED	KYG8259W1033	SOL.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	100,87
SOS CUETARA PREFERENTES, S.A.U.	ES0130124003	SOS.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	48.816,67
TELEFONICA FINANCE USA, L.L.C.	USU87942AA33	TEF.FIN.USA/VAR NACU AMTB PPR		V	1.005,04
UNION FENOSA FINANCIAL SERVICES USA, LLC.	USU90716AA64	UNF.FINL.USA/VAR NACU AMTB PPR		V	24,88

RENTA VARIABLE

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
ABENGOA, S.A.	ES0105200416	ABG/AC 0,25			24,88
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0111845014	ABE/AC 3,00			21,55
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0111845113	ABE/ACPREF 3,00			20,86
ACCIONA, S.A.	ES0125220311	ANA/AC 1,00			134,27
ACERINOX, S.A.	ES0132105018	ACX/AC 0,25			19,27
ACS, ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS, S.A.	ES0167050915	ACS/AC 0,50			40,54
ACTUACIONES ACTIVIDADES E INVERSIONES INMOBILIARIAS, S.A.	ES0106585013	AISA/AC 6,00			20,11
ADOLFO DOMINGUEZ, S.A.	ES0106000013	ADZ/AC 0,60			51,21
AGUAS DE VALENCIA, S.A.	ES0107250013	AGUAS.VAL/AC 3,01			80,65
AHORRO FAMILIAR, S.A.	ES0107511018	AH.FAMILIAR/AC 6,00			30,15
ALFA S.A. DE C.V.	MXP000511016	AC. ALFA S/A			44,97
ALTADIS, S.A.	ES0177040013	ALT/AC 0,10			38,29
AMERICA MOVIL, S.A. DE C.V.	MXP001691213	AC. AMERICA MOVIL. S/L			33,47
AMPER, S.A.	ES0109260531	AMP/AC 1,00			10,17
ANTENA 3 DE TELEVISION, S.A.	ES0109427734	A3TV/AC 0,75			17,69
ARACRUZ CELULOSE, S.A.	BRARCZACNPB3	AC. ARACRUZ CELULOSE. PREF. S/B			4,45
ARCELOR, S.A.	LU0140205948	AC. ARCELOR			42,36
ASTROC MEDITERRANEO, S.A.	ES0110944016	AST/AC 0,20			29,00
AVANZIT, S.A.	ES0172708317	AVZ/AC 1,00			5,08
AYCO GRUPO INMOBILIARIO, S.A.	ES0152960011	AYCO.GRP.INMO/AC 3,01			16,25
AZKOYEN, S.A.	ES0112458312	AZK/AC 0,60			7,68
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0113211835	BBVA/AC 0,49			18,73
BANCO BRADESCO, S.A.	BRBBDACANPR8	BCO BRADESCO/ACPREF			28,68
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0113140133	AND/AC 0,75			97,22
BANCO DE CASTILLA, S.A.	ES0113243135	CAS/AC 0,60			21,84
BANCO DE CHILE, S.A.	CLP0939W1081	AC. BANCO DE CHILE			34,45
BANCO DE CREDITO BALEAR, S.A.	ES0113381133	CBL/AC 0,75			31,72
BANCO DE GALICIA, S.A.	ES0113515136	GAL/AC 0,30			26,70
BANCO DE PROMOCION DE NEGOCIOS, S.A. (PROMOBANC)	ES0113805032	PROMOBANC/AC 1,62			6,48
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0113860532	SAB/AC 0,50			30,61
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0113980330	BVA/AC 1,00			38,94
BANCO DE VASCONIA, S.A.	ES0113997136	VAS/AC 0,30			19,98
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0113440038	BTO/AC 0,79			16,14
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0113580932	GUI/AC 0,50			25,03
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0113580A33	GUI/ACPREF 0,50			24,28
BANCO PASTOR, S.A.	ES0113770434	PAS/AC 0,33			13,65
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0113790531	POP/AC 0,10			13,46
BANCO RIO DE LA PLATA, S.A.	ARBRI0010194	AC. BANCO RIO DE LA PLATA. S/B			0,93
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO, S.A.	ES0113900J37	SAN/AC 0,50			13,64
BANCO SANTANDER PUERTO RICO	PR8028091034	AC. SANTANDER BANCORP			14,37
BANKINTER, S.A.	ES0113679338	BKT/AC 1,50			58,65
BARON DE LEY, S.A.	ES0114297015	BDL/AC 0,60			44,76
BAYER AKTIENGESELLSCHAFT	DE0005752000	AC. BAYER			39,97
BBVA BANCO FRANCES, S.A.	ARP125991090	AC. BBVA BCO. FRANCES			2,30
BEFESA MEDIO AMBIENTE, S.A.	ES0114491014	BMA/AC 3,01			27,52
BODEGAS RIOJANAS, S.A.	ES0115002018	RIO/AC 0,75			9,48
BOLSAS Y MERCADOS ESPAÑOLES, SDAD HOLDING DE MDOS Y STI	ES0115056139	BME/AC 3,23			29,87
BRADESPAR	BRBRAPACNOR5	AC. BRADESPAR			30,80
BRADESPAR	BRBRAPACNPR2	AC. BRADESPAR -PREF.-			31,64
BRASKEM, S.A.	BRBRKMACNPA4	AC. BRASKEM -PREF.-			5,55
C.A. LA ELECTRICIDAD DE CARACAS	US12477A1060	ADS. LA ELECTRICIDAD DE CARACAS			8,10
CAMPOFRIO ALIMENTACION, S.A.	ES0121501318	CPF/AC 1,00			13,86
CARTERA HOTELERA, S.A.	ES0162292017	CART.HOTELERA/AC 2,30			7,13
CEMENTOS MOLINS, S.A.	ES0117360117	CEMENTOS.MOLINS/AC 0,30			23,80
CEMENTOS PORTLAND VALDERRIVAS, S.A.	ES0117390411	CPL/AC 1,50			92,31
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNOR6	AC. ELETROBRAS			8,78
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNPB7	AC. ELETROBRAS . PREF. S/B			8,20
CIE AUTOMOTIVE, S.A.	ES0105630315	CIE/AC 0,25			7,00
CINTRA CONCESIONES DE INFRAESTRUCTURAS DE TRANSPORTE,	ES0118900010	CIN/AC 0,20			12,14
COMPANHIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	BRCMIGACNPR3	AC. CEMIG -PREF.-			34,61
COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	BRCPLACNPR9	AC. COPEL -PREF.-			8,84
COMPANYIA D'AIGÜES DE SABADELL, S.A.	ES0107350011	AGUAS.SAB/AC B 12,02			44,25
COMPAÑIA DE DISTRIBUCION INTEGRAL LOGISTA, S.A.	ES0160973014	LOG/AC 0,60			46,71
COMPAÑIA DE INVERSIONES Cinsa, S.A.	ES0155580014	CINSA/AC 6,01			9,16
COMPAÑIA DE INVERSIONES MOBILIARIAS BARCINO, S.A.	ES0155972237	INV.MOB.BARCINO/AC 1,00			0,90
COMPAÑIA ESPAÑOLA DE PETROLEOS, S.A.	ES0132580319	CEP/AC 1,00			60,24
COMPAÑIA ESPAÑOLA DE VIVIENDAS EN ALQUILER, S.A.	ES0132955016	CEVASA/AC 6,00			202,35
COMPAÑIA ESPAÑOLA PARA LA FABRICACION MECANICA DEL VIDR	ES0132110018	CELO/AC 6,65			5,45
COMPAÑIA LEVANTINA DE EDIFICACION Y OBRAS PUBLICAS, S.A.	ES0158300410	CLEO/AC 1,00			14,31
COMPAÑIA LOGISTICA DE HIDROCARBUROS CLH, S.A.	ES0110480219	CLH/AC D 1,20			38,72
COMPAÑIA VINICOLA DEL NORTE DE ESPAÑA, S.A.	ES0184140210	CUN/AC 0,24			14,49
CONSTRUCCIONES Y AUXILIAR DE FERROCARRILES, S.A	ES0121975017	CAF/AC 3,01			122,24
CORPORACION DERMOESTETICA, S.A.	ES0124204019	DERM/AC 0,10			8,04
CORPORACION FINANCIERA ALBA, S.A.	ES0117160111	ALB/AC 1,00			52,63
CORPORACION GEO, S.A. DE C.V.	MXP3142C1177	AC. GEO. S/B			3,53
CORPORACION MAPFRE, S.A.	ES0124244E34	MAP/AC 0,10			3,44
CORPORACIÓN UBC INTERNACIONAL, S.A.	CRUBCIOA0015	AC. CORPORACION UBC INTERNACIONAL. S/A			4,33
DINAMIA CAPITAL PRIVADO, S.A., SCR	ES0126501131	DIN/AC 3,00			23,46
DISTRIBUCION Y SERVICIOS D&S, S.A.	CL0000000522	AC. DISTRIBUCION Y SERVICIO			14,93
DOGÍ INTERNATIONAL FABRICS, S.A.	ES0126962010	DGI/AC 0,60			3,46
DURO FELGUERA, S.A.	ES0162600417	MDF/AC 0,50			7,02
EBRO PULEVA, S.A.	ES0112501012	EVA/AC 0,60			17,81
ELECNOR, S.A.	ES0129743219	ENO/AC 0,20			26,07
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD, S.A.	CLP3710M1090	AC. ENDESA CHILE			26,12
ENAGAS, S.A.	ES0130960018	ENG/AC 1,50			19,20

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
ENDESA, S.A.	ES0130670112	ELE/AC 1,20			35,03
ENERSIS, S.A.	CLP371861061	AC. ENERSIS			11,35
ERCROS, S.A.	ES0125140014	ECR/AC 0,36			0,82
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE AND SPACE COMPANY EADS, N	NL0000235190	AC. EADS			22,52
EUROPISTAS, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0133848038	EUROP./AC 0,49			8,41
FADESA INMOBILIARIA, S.A.	ES0135961219	FAD/AC 0,10			35,08
FAES FARMA, S.A.	ES0134950536	FAE/AC 0,20			24,96
FEDERICO PATERNINA, S.A.	ES0114989017	PAT/AC 6,01			8,05
FERSA ENERGIAS RENOVABLES, S.A.	ES0136463017	FERSA/AC 1,00			3,27
FINANZAS E INVERSIONES VALENCIANAS, S.A.	ES0138152113	F&I.VALENCIANAS/AC 1,00			70,00
FOMENTO DE CONSTRUCCIONES Y CONTRATAS, S.A.	ES0122060314	FCC/AC 1,00			72,33
FUNESPAÑA, S.A.	ES0140441017	FUN/AC 0,30			8,41
GAESCO HOLDING, S.A.	ES0164228019	GAESCO/AC 3,01			21,87
GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA, S.A.	ES0143416115	GAM/AC 0,17			19,04
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0116870314	GAS/AC 1,00			30,99
GENERAL DE ALQUILER DE MAQUINARIA, S.A.	ES0141571119	GALQ/AC 1,00			13,21
GERDAU, S.A.	BRGGBRACNPR8	AC. GERDAU -PREF.-			11,82
GESTEVISION TELECINCO, S.A.	ES0152503035	TL5/AC 0,50			21,03
GRIFOLS, S.A.	ES0171996012	GRF/AC 0,50			8,34
GRUPO BANISTMO	PAL3021871A6	AC. BANISTMO			39,90
GRUPO CATALANA OCCIDENTE, S.A.	ES0116920333	GCO/AC 0,30			26,00
GRUPO ELEKTRA, S.A. DE C.V.	MX01EL000003	AC. GRUPO ELEKTRA			8,25
GRUPO EMPRESARIAL ENCE, S.A.	ES0130625017	ENC/AC 4,50			39,33
GRUPO FERROVIAL, S.A.	ES0162601019	FER/AC 1,00			71,67
GRUPO INMOCARAL, S.A.	ES0139140018	CAR/AC 0,12			4,82
GRUPO MODELO, S.A. DE C.V.	MXP4833F1044	AC. GRUPO MODELO. S/C			38,62
HISPANA HOLDING, S.A.	ES0145833119	HISPANA.HOLD/AC 1,00			1,29
HULLAS DEL COTO CORTES, S.A.	ES0146790011	HCC/AC 1,20			10,03
IBERDROLA, S.A.	ES0144580018	IBE/AC 3,00			34,42
IBERIA LINEAS AEREAS DE ESPAÑA, S.A.	ES0147200036	IBLA/AC 0,78			2,51
IBERPAPEL GESTION, S.A.	ES0147561015	IBG/AC 0,60			17,28
INBESOS, S.A.	ES0150480111	BES/AC 1,20			14,22
INDO INTERNACIONAL, S.A.	ES0148224118	IDO/AC 1,00			8,70
INDRA SISTEMAS, S.A.	ES0118594417	IDR/AC A 0,20			17,99
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL, S.A.	ES0148396015	ITX/AC 0,15			38,48
INDUSTRIAS DEL ACETATO DE CELULOSA, S.A.	ES0150160010	INACSA/AC 5,00			16,96
INMOBILIARIA COLONIAL, S.A.	ES0153440419	COL/AC 3,00			61,94
INMOBILIARIA DEL SUR, S.A.	ES0154653911	INMO.SUR/AC 2,00			54,97
INMOBILIARIA URBIS, S.A.	ES0154800215	URB/AC 1,19			26,58
INMOFIBAN, S.A.	ES0154936035	INMOFIBAN/AC 1,53			71,50
INMOLEVANTE, S.A.	ES0154949012	INMOLEVANTE/AC 3,00			13,30
INVERFIATC, S.A.	ES0143419010	INVERFIATC/AC 6,00			6,76
INVERPYME, S.A.	ES0155151014	INVERPYME/AC 1,00			1,58
INVERSIONES AZALBA, S.A.	ES0145832012	INV.AZALBA/AC 1,00			2,60
INYPSA INFORMES Y PROYECTOS, S.A.	ES0152768612	INY/AC 0,50			7,54
JAZZTEL, PLC.	GB0057933615	AC. JAZZTEL			0,47
LA SEDA DE BARCELONA, S.A.	ES0175290115	SED/AC 1,00			2,25
LEFA, S.A.	ES0158150013	LEFA/AC 30,05			25,00
LIBERTAS 7, S.A.	ES0137998A12	LIBERTAS.7/AC 0,50			25,63
LINGOTES ESPECIALES, S.A.	ES0158480311	LGT/AC 1,00			7,72
LIWE ESPAÑOLA, S.A.	ES0158545030	LIWE.ESPAÑOLA/AC 3,15			9,20
MICALUX, S.A.	ES0161928116	MLX/AC 1,00			29,75
METROVACESA, S.A.	ES0154220414	MVC/AC 1,50			121,26
MINERALES Y PRODUCTOS DERIVADOS, S.A.	ES0163960018	MIN&PROD.DERIV/AC 9,00			23,05
MIQUEL Y COSTAS & MIQUEL, S.A.	ES0164180012	MCM/AC 2,00			24,82
MITTAL STEEL COMPANY, N.V.	NL0000361947	AC. ARCELOR MITTAL			31,64
MONTEBALITO, S.A.	ES0116494016	MTB/AC 1,00			17,37
NATRA, S.A.	ES0165515117	NAT/AC 1,20			10,43
NATRACEUTICAL, S.A.	ES0165359011	NTC/AC 0,10			1,87
NET SERVIÇOS DE COMUNICAÇÃO, S.A.	BRNETCACNPR3	AC. NET SERVIÇOS DE COMUNICAÇÃO -PREF.-			8,03
NH HOTELES, S.A.	ES0161560018	NHH/AC 2,00			15,82
NICOLAS CORREA, S.A.	ES0166300212	NEA/AC 0,80			4,85
OBRASCON HUARTE LAIN, S.A.	ES0142090317	OHL/AC 0,60			20,46
PAPELES Y CARTONES DE EUROPA, S.A.	ES0168561019	PAC/AC 2,00			6,75
PARQUESOL INMOBILIARIA Y PROYECTOS, S.A.	ES0168632018	PSL/AC 1,00			23,69
PESCANOVA, S.A.	ES0169350016	PVA/AC 6,00			26,92
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNOR9	AC. PETROBRAS			17,54
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNPR6	AC. PETROBRAS -PREF.-			15,90
PLARREGA INVEST 2000, S.A.	ES0168626010	PLARREGA2000/AC 6,01			6,01
PRIM, S.A.	ES0170884417	PRM/AC 0,25			15,16
PROMOTORA DE INFORMACIONES, S.A.	ES0171743117	PRS/AC 0,10			13,31
PROSEGUR, COMPAÑIA DE SEGURIDAD, S.A.	ES0175438235	PSG/AC 0,60			24,27
PULEVA BIOTECH, S.A.	ES0172233118	BIO/AC 0,24			2,55
RED ELECTRICA DE ESPAÑA, S.A.	ES0173093115	REE/AC 2,00			32,19
RENO DE MEDICI, S.P.A.	IT0001178299	AC. RENO DE MEDICI. S/A			0,54
RENTA CORPORACION REAL ESTATE, S.A.	ES0173365018	REN/AC 1,00			31,15
REPSOL YPF, S.A.	ES0173516115	REP/AC 1,00			26,55
RIOFISA, S.A.	ES0173964018	RFS/AC 0,20			33,13
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES0182870214	SYV/AC 1,00			44,28
SADIA, S.A.	BRSDIAACNPR1	AC. SADIA -PREF.-			2,38
SARE HOLDING, S.A., DE C.V.	MX01SA030007	AC. SARE. S/B			9,34
SERVICE POINT SOLUTIONS, S.A.	ES0143421G11	SPS/AC 0,60			3,05
SNIACE, S.A.	ES0165380017	SNC/AC 0,10			4,49
SOCIEDAD ANONIMA DAMM	ES0125690117	DAMM/AC 1,00			42,71
SOCIEDAD ANONIMA HULLERA VASCO-LEONESA	ES0146940012	HULLERA.VAS-LE/AC 3,01			4,76

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (*)	Valor Medio Euros
SOCIEDAD ESPAÑOLA DEL ACUMULADOR TUDOR, S.A.	ES0131600019	TUD/AC 3,01			8,91
SOCIEDAD GENERAL DE AGUAS DE BARCELONA, S.A.	ES0141330C19	AGS/AC 1			26,78
SOCIEDAD GENERAL DE AGUAS DE BARCELONA, S.A.	ES0141330L18	AGS/ACNV 1			26,55
SOGEABLE, S.A.	ES0178483139	SGC/AC 2,00			26,28
SOL MELIA, S.A.	ES0176252718	SOL/AC 0,20			14,77
SOS CUETARA, S.A.	ES0110047919	SOS/AC 1,50			12,53
SOTOGRADE, S.A.	ES0138109014	STG/AC 0,60			15,71
SUZANO BAHIA SUL PAPEL E CELULOSE, S.A.	BRSUZBACNPA3	AC. SUZANO BAHIA SUL -PREF.-			3,48
SUZANO PETROQUIMICA, S.A.	BRSZPQACNPR5	AC. SUZANO PETROQUIMICA -PREF.-			0,29
TABLEROS DE FIBRAS, S.A.	ES0177080118	TFI/AC 0,50			1,53
TAVEX ALGODONERA, S.A.	ES0108180219	ASA/AC 0,92			3,37
TECNICAS REUNIDAS, S.A.	ES0178165017	TRE/AC 0,10			27,39
TECNOCOM, TELECOMUNICACIONES Y ENERGIA, S.A.	ES0147582318	CIB/AC 1,00			12,55
TELE PIZZA, S.A.	ES0178344117	TPZ/AC 0,03			3,19
TELEFONICA PUBLICIDAD E INFORMACION, S.A.	ES0178419117	TPI/AC 0,05			8,33
TELEFONICA, S.A.	ES0178430E18	TEF/AC 1,00			15,17
TELEFONOS DE MEXICO, S.A.	MXP904131325	AC. TELMEX. S/L			20,78
TESTA INMUEBLES EN RENTA, S.A.	ES0170885018	TST/AC 6,00			28,56
TUBACEX, S.A.	ES0132945017	TUB/AC 0,45			4,77
TUBOS REUNIDOS, S.A.	ES0180850317	TRG/AC 0,40			16,90
TV AZTECA, S.A. DE C.V.	MXP740471117	AC. TV AZTECA			5,35
UNION EUROPEA DE INVERSIONES, S.A.	ES0181480114	U EUROPEA INV/AC 1,00			30,52
UNION EUROPEA DE INVERSIONES, S.A.	ES0181480411	U EUROPEA INV/ACNV 1,00			29,62
UNION FENOSA, S.A.	ES0181380017	UNF/AC 3,00			39,55
UNIPAPEL, S.A.	ES0182045312	UPL/AC 1,50			22,07
URALITA, S.A.	ES0182170615	URA/AC 0,72			4,87
URBAR INGENIEROS, S.A.	ES0182484115	URBAR.ING/AC 1,00			15,61
URBAS, PROYECTOS URBANISTICOS, S.A.	ES0182280018	URBAS/AC 0,64			2,87
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNPA6	AC. USIMINAS -PREF.-			26,54
VALE DO RIO DOCE,COMPANHIA	BRVALEACNOR0	AC. VALE DO RIO DOCE			20,39
VALE DO RIO DOCE,COMPANHIA	BRVALEACNPA3	AC. VALE DO RIO DOCE. PREF. 6%			17,38
VALENCIANA DE NEGOCIOS, S.A.	ES0182785214	VALENCIANA.NEG/AC 1,00			23,76
VIDRALA, S.A.	ES0183746314	VID/AC 1,02			21,43
VISCOFAN, S.A.	ES0184262212	VIS/AC 0,30			13,54
VOCENTO, S.A.	ES0114820113	VOC/AC 0,20			14,94
VOLCAN COMPAÑIA MINERA, S.A.A.	PEP648014202	AC. VOLCAN. PREF. S/B			15,22
VUELING AIRLINES, S.A.	ES0184591032	VLG/AC 0,01			32,26
ZARDOYA OTIS, S.A.	ES0184933812	ZOT/AC 0,10			23,21
ZELTIA, S.A.	ES0184940817	ZEL/AC 0,05			5,73