

III. OTRAS DISPOSICIONES

MINISTERIO DE ECONOMÍA Y HACIENDA

3129 *Orden EHA/417/2010, de 24 de febrero, por la que se aprueba la relación de valores negociados en mercados organizados, con su valor de negociación medio correspondiente al cuarto trimestre de 2009, a efectos de la declaración informativa anual acerca de valores, seguros y rentas.*

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

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

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

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

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

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

En su virtud, dispongo:

Artículo único. Aprobación de las relaciones de valores negociados.

Se aprueba la relación de valores negociados en Bolsa con su cotización media correspondiente al cuarto trimestre de 2009; 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 2009, anexas a esta Orden, a efectos de la cumplimentación de la declaración informativa anual acerca de valores, seguros y rentas, aprobada por la Orden EHA/3481/2008, de 1 de diciembre.

Disposición final única. *Entrada en vigor.*

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

Madrid, 24 de febrero de 2010.—La Vicepresidenta Segunda del Gobierno y Ministra de Economía y Hacienda, Elena Salgado Méndez.

ANEXO A LA ORDEN DE

Relación de valores o participaciones con su valor de negociación medio o de liquidación media relativa al cuarto trimestre de 2009, a efectos previstos en el artículo 39 del Real Decreto 1.065/2007, de 27 de julio, por el que se aprueba el Reglamento General de las actuaciones y los procedimientos de gestión e inspección tributaria y de desarrollo de las normas comunes de los procedimientos de aplicación de los tributos

Criterio de ordenación:

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

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

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
COMUNIDAD AUTONOMA DE ARAGON	ES0000107088	CC.AA.ARA/5,45 OB 20161031	31/10/2016	5,450	
COMUNIDAD AUTONOMA DE ARAGON	ES0000107179	CC.AA.ARA/2,40 BO 20121216	16/12/2012	2,400	100,000
COMUNIDAD AUTONOMA DE BALEARES	ES0001348038	CC.AA.BAL/9,75 OB 20090531	31/05/2009	9,750	
COMUNIDAD AUTONOMA DE CASTILLA - LEON	ES0001351123	CC.AA.C-LE/4,75 OB SEGR 20111126	26/11/2011	4,750	
COMUNIDAD AUTONOMA DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0001350075	JUNTA.CLM/6,00 OB SEGR 20100131	31/01/2010	6,000	
COMUNIDAD AUTONOMA DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0001350083	JUNTA.CLM/6,00 OB 20110715	15/07/2011	6,000	
COMUNIDAD AUTONOMA DE MURCIA	ES0000102113	CC.AA.MUR/4,80 OB SEGR 20111130	30/11/2011	4,800	
COMUNIDAD DE MADRID	ES0000101362	CC.AA.MAD/4,051 BO 20130612	12/06/2013	4,051	104,280
COMUNIDAD FORAL NAVARRA	ES0001353061	OB. COMUNIDAD FORAL DE NAVARRA	12/05/2005	12,350	
COMUNIDAD FORAL NAVARRA	ES0001353186	CC.AA.NAV/4,85 OB 20111128	28/11/2011	4,850	
DIPUTACION FORAL DE VIZCAYA	ES0201570001	DIPT.VIZCAYA/11,30 OB 20141220	20/12/2014	11,300	135,000
DIPUTACION FORAL DE VIZCAYA	ES0201570027	DIPT.VIZCAYA/5,45 OB 20130608	08/06/2013	5,450	102,000
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011355	OBLIGACIONES DEL ESTADO	15/01/2002	11,300	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011371	OBLIGACIONES DEL ESTADO	15/06/2002	10,300	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011413	OBLIGACIONES DEL ESTADO	30/08/2003	10,900	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011421	OBLIGACIONES DEL ESTADO	30/10/2003	10,500	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011470	ESTADO/8,20 OBE 20090228	28/02/2009	8,200	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011488	OBLIGACIONES DEL ESTADO	30/05/2004	8,000	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011512	OBLIGACIONES DEL ESTADO	28/02/2005	10,000	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011546	OBLIGACIONES DEL ESTADO	31/01/2006	10,150	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011579	OBLIGACIONES DEL ESTADO	30/04/2006	8,800	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011595	ESTADO/8,70 OBE 20120228	28/02/2012	8,700	115,570
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011603	BONOS DEL ESTADO	28/02/2002	7,900	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011629	ESTADO/7,35 OBE 20070331	31/03/2007	7,350	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011645	BONOS SEGREGABLES DEL TESORO	31/01/2003	5,250	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011652	ESTADO/6,00 OBE SEGR 20080131	31/01/2008	6,000	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011660	ESTADO/6,15 OBE SEGR 20130131	31/01/2013	6,150	112,437
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011686	PRINCIPAL SEGREGADO	31/01/2003	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011694	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20080131	31/01/2008	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011702	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20130131	31/01/2013	C	93,500
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011744	CUPON SEGREGADO	31/01/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011751	CUPON SEGREGADO	31/01/2003	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011769	CUPON SEGREGADO	31/01/2004	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011777	CUPON SEGREGADO	31/01/2005	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011785	CUPON SEGREGADO	31/01/2006	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011793	TESORO/CUPCER CUPSEGR 20070131	31/01/2007	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011801	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20080131	31/01/2008	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011819	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20090131	31/01/2009	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011827	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20100131	31/01/2010	C	99,896
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011835	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20110131	31/01/2011	C	98,630
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011843	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20120131	31/01/2012	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011850	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20130131	31/01/2013	C	93,647
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011868	ESTADO/6,00 OBE SEGR 20290131	31/01/2029	6,000	119,291
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011876	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20290131	31/01/2029	C	40,831
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011884	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20140131	31/01/2014	C	89,470
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011892	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20150131	31/01/2015	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011900	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20160131	31/01/2016	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011918	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170131	31/01/2017	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011926	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20180131	31/01/2018	C	74,456
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011934	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20190131	31/01/2019	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011942	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20200131	31/01/2020	C	66,789
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011959	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20210131	31/01/2021	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011967	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20220131	31/01/2022	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011975	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20230131	31/01/2023	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011983	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20240131	31/01/2024	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000011991	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20250131	31/01/2025	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012007	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20260131	31/01/2026	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012023	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20270131	31/01/2027	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012031	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20280131	31/01/2028	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012049	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20290131	31/01/2029	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012064	ESTADO/5,15 OBE SEGR 20090730	30/07/2009	5,150	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012072	BONOS SEGREGABLES DEL TESORO	30/07/2002	4,250	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012080	BONOS SEGREGABLES DEL TESORO	30/07/2004	4,500	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012098	ESTADO/4,75 OBE SEGR 20140730	30/07/2014	4,750	109,399
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000120B5	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20370131	31/01/2037	C	27,033
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000120D1	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20370131	31/01/2037	C	28,843
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000120E9	ESTADO/3,25 BOEST SEGR 20100730	30/07/2010	3,250	101,767
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000120F6	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20100730	30/07/2010	C	99,300
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000120G4	ESTADO/3,15 OBE SEGR 20160131	31/01/2016	3,150	100,472
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000120I0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20160131	31/01/2016	C	82,240
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000120J8	ESTADO/3,80 OBE SEGR 20170131	31/01/2017	3,800	103,056
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000120L4	ESTADO/3,90 BOEST SEGR 20121031	31/10/2012	3,900	105,686
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000120M2	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20170131	31/01/2017	C	78,250
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000120N0	ESTADO/4,90 OBE SEGR 20400730	30/07/2040	4,900	105,446

(*) ANCV: Agencia Nacional de Codificación de Valores

(**) V: Cupón Variable, C: Cupón Cero

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012008	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20400730	30/07/2040	C	24,793
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000120U5	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20380730	30/07/2038	C	26,541
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000120X9	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20121031	31/10/2012	C	94,725
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000120Y7	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20121031	31/10/2012	C	94,338
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000120Z4	ESTADO/4,10 BOEST SEGR 20110430	30/04/2011	4,100	104,164
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012106	PRINCIPAL SEGREGADO	30/07/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012110	PRINCIPAL SEGREGADO	30/07/2004	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012122	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20090730	30/07/2009	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012155	CUPON SEGREGADO	30/07/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012163	CUPON SEGREGADO	30/07/2003	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012171	CUPON SEGREGADO	30/07/2004	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012189	CUPON SEGREGADO	30/07/2005	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012197	CUPON SEGREGADO	30/07/2006	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121A5	ESTADO/4,10 OBE SEGR 20180730	30/07/2018	4,100	103,702
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121F4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20180730	30/07/2018	C	72,875
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121G2	ESTADO/4,80 OBESEGR 20240131	31/01/2024	4,800	105,970
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121H0	ESTADO/4,25 BOEST SEGR 20140131	31/01/2014	4,250	106,992
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121I8	ESTADO/2,75 BOEST SEGR 20120430	30/04/2012	2,750	102,578
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121K4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20240131	31/01/2024	C	53,113
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121L2	ESTADO/4,60 OBESEGR 20190730	30/07/2019	4,600	106,649
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121M0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20120430	30/04/2012	C	96,123
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121O6	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20191031	31/10/2019	4,300	103,900
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121P3	ESTADO/3,30 BOEST SEGR 20141031	31/10/2014	3,300	102,603
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121Q1	ESTADO/VAR BOEST SEGR 20121029	29/10/2012	V	99,982
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121S7	ESTADO/4,00 OBE SEGR 20100131	30/07/2041	4,700	101,528
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121T5	ESTADO/2,30 BOEST SEGR 20130430	30/04/2013	2,300	100,247
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012205	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20070730	30/07/2007	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012213	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20080730	30/07/2008	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012221	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20090730	30/07/2009	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012239	ESTADO/4,70 OBE SEGR 20100131	31/01/2010	4,000	100,680
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012247	BONOS SEGREGABLES DEL TESORO	31/01/2003	3,000	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012254	BONOS SEGREGABLES DEL TESORO	31/01/2005	3,250	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012270	PRINCIPAL SEGREGADO	31/01/2003	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012288	PRINCIPAL SEGREGADO	31/01/2005	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012296	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20100131	31/01/2010	C	99,843
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012304	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20140730	30/07/2014	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012312	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20100730	30/07/2010	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012320	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20110730	30/07/2011	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012338	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20120730	30/07/2012	C	94,937
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012346	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20130730	30/07/2013	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012353	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20140730	30/07/2014	C	88,530
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012361	BONOS SEGREGABLES DEL TESORO	30/07/2003	4,600	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012379	BONOS SEGREGABLES DEL TESORO	30/07/2005	4,950	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012387	ESTADO/5,40 OBE SEGR 20110730	30/07/2011	5,400	106,864
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012395	PRINCIPAL SEGREGADO	30/07/2003	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012403	PRINCIPAL SEGREGADO	30/07/2005	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012411	ESTADO/5,75 OBE 20320730	30/07/2032	5,750	116,902
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012429	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20110730	30/07/2011	C	97,885
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012437	BONOS SEGREGABLES DEL TESORO	31/10/2004	4,650	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012445	BONOS SEGREGABLES DEL TESORO	31/10/2006	4,800	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012452	ESTADO/5,35 OBE SEGR 20111031	31/10/2011	5,350	107,524
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012460	PRINCIPAL SEGREGADO	31/10/2004	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012502	PRINCIPAL SEGREGADO	31/10/2006	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012510	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20111031	31/10/2011	C	97,254
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012593	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20320730	30/07/2032	C	34,053
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012601	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20150730	30/07/2015	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012619	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20160730	30/07/2016	C	80,750
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012627	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170730	30/07/2017	C	77,208
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012635	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20180730	30/07/2018	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012643	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20190730	30/07/2019	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012650	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20200730	30/07/2020	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012668	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20210730	30/07/2021	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012676	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20220730	30/07/2022	C	58,401
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012684	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20230730	30/07/2023	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012692	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20240730	30/07/2024	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012700	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20250730	30/07/2025	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012718	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20260730	30/07/2026	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012726	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20270730	30/07/2027	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012734	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20280730	30/07/2028	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012742	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20290730	30/07/2029	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012750	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20300730	30/07/2030	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012767	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20310730	30/07/2031	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012775	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20320730	30/07/2032	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012783	ESTADO/5,50 OBE SEGR 20170730	30/07/2017	5,500	114,199
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012791	ESTADO/5,00 OBE SEGR 20120730	30/07/2012	5,000	108,369
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012817	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20170730	30/07/2017	C	76,942
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012866	ESTADO/4,20 OBE SEGR 20130730	30/07/2013	4,200	106,709
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012874	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20130730	30/07/2013	C	92,049
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012916	ESTADO/4,40 OBE SEGR 20150131	31/01/2015	4,400	107,662
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012932	ESTADO/4,20 OBE SEGR 20370131	31/01/2037	4,200	94,446
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES00000950A7	GENCAT/VAR BO 20110428	28/04/2011	V	101,322
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095259	GENCAT/11,65 OB 20100619	19/06/2010	11,650	105,274
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095606	GENCAT/5,325 OB 20281005	05/10/2028	5,325	100,136
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095721	GENCAT/5,80 OB 20101130	30/11/2010	5,800	101,730
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095788	GENCAT/VAR OB 20171017	17/10/2017	V	97,899

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095812	GENCAT/VAR OB 20180613	13/06/2018	V	85,715
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095846	GENCAT/3,75 BO 20100215	15/02/2010	3,750	100,845
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095853	GENCAT/4,69 OB 20341028	28/10/2034	4,690	87,170
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095861	GENCAT/3,875 OB 20150915	15/09/2015	3,875	104,797
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095879	GENCAT/4,22 OB 20350426	26/04/2035	4,220	84,549
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095887	GENCAT/3,25 OB 20111130	30/11/2011	3,250	102,275
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095895	GENCAT/4,30 OB 20161115	15/11/2016	4,300	104,048
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095903	GENCAT/4,12 BO 20130423	23/04/2013	4,125	104,130
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095911	GENCAT/3,85 BO 20110930	30/09/2011	3,850	103,322
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095929	GENCAT/4,75 OB 20180604	04/06/2018	4,750	102,598
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095A54	GENCAT/PAG 20100209	09/02/2010		99,911
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095A62	GENCAT/PAG 20100223	23/02/2010		99,857
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095A88	GENCAT/PAG 20100323	23/03/2010		99,826
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095A96	GENCAT/PAG 20100119	19/01/2010		99,811
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095B12	GENCAT/PAG 20100511	11/05/2010		99,758
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095B20	GENCAT/PAG 20100608	08/06/2010		99,515
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095B38	GENCAT/PAG 20100706	06/07/2010		99,157
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095B46	GENCAT/PAG 20100309	09/03/2010		99,812
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095B61	GENCAT/PAG 20101005	05/10/2010		98,784
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095B87	GENCAT/PAG 20101109	09/11/2010		98,824
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095B95	GENCAT/PAG 20101207	07/12/2010		98,782
GOBIERNO VASCO	ES0000106429	GOB.VASCO/5,55 OB 20141126	26/11/2014	5,550	111,683
GOBIERNO VASCO	ES0000106437	GOB.VASCO/4,15 OB 20191028	28/10/2019	4,150	99,952
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0255281059	INST.CAT.FIN/VAR OB 20131204	04/12/2013	V	97,789
INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL	ES0200130278	ICO/6,75 OB 20070102	02/01/2007	6,750	
INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL	ES0200130351	ICO/6,00 OB 20070707	07/07/2007	6,000	
INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL	ES0200130393	OB. ICO	18/12/2003	5,000	
INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL	ES0300130194	BO. ICO. % VAR	26/11/2002	V	
JUNTA DE ANDALUCIA	ES0000090227	BO. JUNTA DE ANDALUCIA	27/02/2002	7,100	
JUNTA DE ANDALUCIA	ES0000090268	BO. JUNTA DE ANDALUCIA	26/02/2003	5,500	
JUNTA DE ANDALUCIA	ES0000090292	BO. SEGREGABLES JUNTA DE ANDALUCIA	30/07/2002	4,200	
JUNTA DE ANDALUCIA	ES0000090300	BO. SEGREGABLES JUNTA DE ANDALUCIA	30/07/2004	4,400	
JUNTA DE ANDALUCIA	ES0000090391	BO. JUNTA DE ANDALUCIA	15/11/2004	3,750	
JUNTA DE ANDALUCIA	ES0000090409	JUNTA.AND/5,375 OB SEGR 20120530	30/05/2012	5,375	107,500
JUNTA DE ANDALUCIA	ES05000900G8	PAG. JUNTA DE ANDALUCIA	26/04/2002		
JUNTA DE ANDALUCIA	ES05000900M6	PAG. JUNTA DE ANDALUCIA	25/10/2002		
SOCIEDAD ESTATAL DE PARTICIPACIONES INDUSTRIALES	ES0202010023	OB. INI	27/04/2003	11,300	
SOCIEDAD ESTATAL DE PARTICIPACIONES INDUSTRIALES	ES0202010049	SEPI/8,64 OB 20081220	20/12/2008	8,640	
XUNTA DE GALICIA	ES0001352055	XUNTA/12,80 OB 20071228	28/12/2007	12,800	
XUNTA DE GALICIA	ES0001352147	XUNTA/5,40 OB 20180720	20/07/2018	5,400	
XUNTA DE GALICIA	ES0001352170	XUNTA/VAR OB 20081203	03/12/2008	V	
XUNTA DE GALICIA	ES0001352287	XUNTA/4,10 BO 20140612	12/06/2014	4,100	103,760
XUNTA DE GALICIA	ES0001352295	XUNTA/4,205 BO 20191130	30/11/2019	4,205	100,000

**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.	ES0000230211	BCO.CTO.LOCAL/4,00 CEDHIP 20120331	31/03/2012	4,000	5,76
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0255281083	INST.CAT.FIN/4,50 OB 20150423	23/04/2015	4,500	101,919
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0255281125	INST.CAT.FIN/4,10 OB 20151030	30/10/2015	4,100	100,000
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0255281133	INST.CAT.FIN/VAR OB 20291022	22/10/2029	V	99,750

LETRAS DEL TESORO

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00201043	LETRAS DEL TESORO	04/01/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00201183	LETRAS DEL TESORO	18/01/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00202017	LETRAS DEL TESORO	01/02/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00202157	LETRAS DEL TESORO	15/02/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00203015	LETRAS DEL TESORO	01/03/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00203155	LETRAS DEL TESORO	15/03/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00203288	LETRAS DEL TESORO	28/03/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00204120	LETRAS DEL TESORO	12/04/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00204260	LETRAS DEL TESORO	26/04/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00205101	LETRAS DEL TESORO	10/05/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00205242	LETRAS DEL TESORO	24/05/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00206216	LETRAS DEL TESORO	21/06/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00207057	LETRAS DEL TESORO	05/07/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00207198	LETRAS DEL TESORO	19/07/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00208162	LETRAS DEL TESORO	16/08/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00209137	LETRAS DEL TESORO	13/09/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00210119	LETRAS DEL TESORO	11/10/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00211083	LETRAS DEL TESORO	08/11/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00212057	LETRAS DEL TESORO	05/12/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00301033	LETRAS DEL TESORO	03/01/2003	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00301314	LETRAS DEL TESORO	31/01/2003	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00302288	LETRAS DEL TESORO	28/02/2003	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00303286	LETRAS DEL TESORO	28/03/2003	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00304250	LETRAS DEL TESORO	25/04/2003	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00305232	LETRAS DEL TESORO	23/05/2003	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00306206	LETRAS DEL TESORO	20/06/2003	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L01001228	ESTADO/LT 20100122	22/01/2010	C	99,910
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L01002192	ESTADO/LT 20100219	19/02/2010	C	99,859
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L01003190	ESTADO/LT 20100319	19/03/2010	C	99,815
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L01004230	ESTADO/LT 20100423	23/04/2010	C	99,729
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L01005211	ESTADO/LT 20100521	21/05/2010	C	99,599
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L01006185	ESTADO/LT 20100618	18/06/2010	C	99,530
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L01007233	ESTADO/LT 20100723	23/07/2010	C	99,444
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L01008207	ESTADO/LT 20100820	20/08/2010	C	99,311
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L01009247	ESTADO/LT 20100924	24/09/2010	C	99,246
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L01010229	ESTADO/LT 20101022	22/10/2010	C	99,197
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L01011193	ESTADO/LT 20101119	19/11/2010	C	99,148
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L01012175	ESTADO/LT 20101217	17/12/2010	C	99,128

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	106.388,46
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845187	ABE/4,95 OB 20130808	08/08/2013	4,950	107.284,56
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845203	ABE/4,375 OB 20200330	30/03/2020	4,375	97.997,35
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845211	ABE/5,125 OB 20170612	12/06/2017	5,125	53.600,16
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845237	ABE/4,625 OB 20161014	14/10/2016	4,625	49.987,68
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR-LEONESA, S.A.	ES0211843083	AUCALSA/4,00 OB 20140608	08/06/2014	4,000	488,72
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR-LEONESA, S.A.	ES0211843091	AUCALSA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3,700	466,33
AUTOPISTA VASCO-ARAGONESA, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211837077	AVASA/3,55 OB 20150615	15/06/2015	3,550	946,11
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839107	AUDASA/4,19 OB 20110531	31/05/2011	4,190	492,39
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839115	AUDASA/4,33 OB 20120516	16/05/2012	4,330	616,02
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839123	AUDASA/3,83 OB 20130626	26/06/2013	3,830	507,83
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839131	AUDASA/4,00 OB 20140608	08/06/2014	4,000	488,46
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839149	AUDASA/3,32 OB 20151212	12/12/2015	3,320	465,29
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839156	AUDASA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3,700	468,23
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839164	AUDASA/4,85 OB 20180327 GTIA	27/03/2018	4,850	489,66
AUTOVIA DE LOS VIÑEDOS, S.A.CONCES.D LA JUNTA DE COMUN	ES0211966009	AUVISA/4,79 OB 20271215	15/12/2027	4,790	84.330,67
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211081	BBVA/VAR OB SUBD 20105112	12/11/2015	V	100.110,59
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211099	BBVA/VAR OB SUBD 20191020	20/10/2019	V	101.769,74
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211123	BBVA/CUPCER OBESTR 20160411	11/04/2016	C	56.290,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213180013	ATL/VAR OB SUBD 20101001	01/10/2010	V	600,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860036	SAB/VAR OB SUBD 20160525	25/05/2016	V	86.787,44
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980016	BVA/VAR OB SUBD 20110329	29/03/2011	V	6.014,25
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980024	BVA/VAR OB SUBD 20141215	15/12/2014	V	3.011,13
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980040	BVA/VAR OB SUBD 20170323	23/03/2017	V	47.305,24
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051008	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20130630	30/06/2013	V	599,47
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051016	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20131030	30/10/2013	V	598,92
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051024	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20160421	21/04/2016	V	48.756,89
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051057	BCO.GALLEGO/VAR OBSUBD 20191229	29/12/2019	V	100,00
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580006	GUI/4,75 OB SUBD 20110415	15/04/2011	4,750	500,69
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580014	GUI/4,50 OB SUBD 20121015	15/10/2012	4,500	502,25
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580022	GUI/4,20 OB SUBD 20141015	15/10/2014	4,200	500,31
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790001	POP/VAR OBSUBD 20191222	22/12/2019	V	50.078,91
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0213900147	SAN/12,70 OB SUBD 20101226	26/12/2010	12,700	167.022,77
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0213540018	BBE/VAR OB SUBD 20160323	23/03/2016	V	97.435,20
BANKINTER, S.A.	ES0213679121	BKT/VAR OB 20150316	16/03/2015	V	497,31
BANKINTER, S.A.	ES0213679188	BKT/VAR OBSUBD 20181010	10/10/2018	V	50.000,00
BANKINTER, S.A.	ES0213679196	BKT/6,375 OBSUBD 20190911	11/09/2019	6,375	51.830,55
BARCLAYS BANK, S.A.	ES0214050041	ZRG/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	89.493,48
BILBAO BIZKAIA KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA	ES0214100010	BBK/VAR OB SUBD 20160301	01/03/2016	V	89.686,92
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0257080004	BPEF/VAR OB SUBD 20140630	30/06/2014	V	943,65
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0214958011	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20180108	08/01/2018	V	29,79
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0214958029	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20180804	04/08/2018	V	600,02
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0214958037	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20190126	26/01/2019	V	600,00
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0214958052	CAIXANOVA/VAR OB SUBD PERP		V	34.476,82
CAIXA D'ESTALVIS COMARCAL DE MANLLEU	ES0214841027	CA.MANLLEU/VAR OB SUBD 20130601	01/06/2013	V	499,94
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840201	CA.CATALUNYA/VAR OB SUBD 20150519	19/05/2015	V	1.500,05
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840235	CA.CATALUNYA/VAR OB SUBD 20200220	20/02/2020	V	1.500,09
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840250	CA.CATALUNYA/VAR OB 20120706	06/07/2012	V	95.659,35
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840342	CA.CATALUNYA/VAR OBSUBD 20181218	18/12/2018	V	500,08
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0213249008	CA.GIRONA/VAR OB SUBD 20160921	21/09/2016	V	94.923,65
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0214973077	CA.SABADELL/VAR OBSUBD 20240610	10/06/2024	V	990,47
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0314973027	CA.SABADELL/VAR OB SUBD PERP		V	599,29
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346000	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20150527	27/05/2015	V	600,00
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346018	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20151027	27/10/2015	V	600,00
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346026	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20160427	27/04/2016	V	600,01
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346034	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20161027	27/10/2016	V	600,00
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	500,01
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974018	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD PERP		V	601,01
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974034	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20131230	30/12/2013	V	1.000,07
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974042	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20190730	30/07/2019	V	1.000,16
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974067	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20210809	09/08/2021	V	84.006,28
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974091	CA.TERRASSA/VAR OB 20170627	27/06/2017	V	70.859,33
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974117	CA.TERRASSA/VAR OBSUBD 20190929	29/09/2019	V	999,41
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966006	CA.PENEDES/VAR OB SUBD PERP		V	600,56
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966014	CA.PENEDES/VAR OB SUBD PERP		V	999,50
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966022	CA.PENEDES/VAR OB SUBD 20161122	22/11/2016	V	999,53
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966030	CA.PENEDES/VAR OBSUBD 20190629	29/06/2019	V	999,46
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0214846042	CA.LAIETANA/VAR OB SUBD 20211010	10/10/2021	V	999,82
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0214846059	CA.LAIETANA/VAR OB SUBD 20350315	15/03/2035	V	999,81
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979066	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20111106	06/11/2011	V	1.000,00
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	ES0214979132	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20141025	25/10/2014	V	1.000,01
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979157	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20151128	28/11/2015	V	999,89
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979173	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20171227	27/12/2017	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0214826010	CAJASTUR/VAR OBSUBD 20190616	16/06/2019	V	100,00
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214825012	CA.ALBACETE/VAR OB SUBD PERP		V	609,29
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214825020	CA.ALBACETE/VAR OB SUBD PERP		V	607,13
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214842017	CA.CUENCA-C.R./VAR OB SUBD PERP		V	302,29
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214842025	CA.CUENCA-C.R./VAR OB PREF PERP		V	305,06
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	ES0215424138	CCM/VAR OB SUBD 20171214	14/12/2017	V	93.343,84
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424161	CCM/VAR OB SUBD PERP		V	73.700,04

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843015	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD PERP		V	598,56
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843023	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD PERP		V	600,98
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843080	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20121001	01/10/2012	V	577,72
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843098	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20131103	03/11/2013	V	585,51
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843106	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20140401	01/04/2014	V	584,49
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843114	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20150104	04/01/2015	V	565,36
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843122	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20150704	04/07/2015	V	567,42
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843130	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20160912	12/09/2016	V	41.995,30
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845002	CAI/VAR OB SUBD 20131222	22/12/2013	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845010	CAI/VAR OB SUBD 20140629	29/06/2014	V	98.678,41
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845036	CAI/VAR OB SUBD 20190228	28/02/2019	V	999,99
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600035	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	302,41
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600043	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	303,53
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600050	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	300,45
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	300,49
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600175	CA.MURCIA/VAR OB SUBD 20141215	15/12/2014	V	299,97
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600191	CA.MURCIA/VAR OB SUBD 20230630	30/06/2023	V	500,00
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0214854012	CAJADUERO/VAR OBSUBD 20150630	30/06/2015	V	41.895,97
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0214854038	CAJADUERO/VAR OBSUBD 20190928	28/09/2019	V	998,11
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0214975007	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20121010	10/10/2012	V	999,98
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0214975015	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20140330	30/03/2014	V	999,98
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0214975023	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20151213	13/12/2015	V	47.951,80
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977037	BANCAJAVAR OB SUBD PERP		V	601,38
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977052	BANCAJAVAR OB SUBD 20220704	04/07/2022	V	1.000,02
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977060	BANCAJA/3,94 OB 20150918	18/09/2015	3,940	1.000,30
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977078	BANCAJAVAR OB SUBD 20181129	29/11/2018	V	65.562,87
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977086	BANCAJAVAR OB 20120606	06/06/2012	V	91.725,88
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977094	BANCAJAVAR OB 20160125	25/01/2016	V	76.498,13
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977102	BANCAJAVAR OB SUBD PERP		V	50.934,99
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977128	BANCAJA/4,25 OB 20130526	26/05/2013	4,250	95.246,29
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977136	BANCAJAVAR OB 20130923	23/09/2013	V	85.200,76
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977144	BANCAJA/4,375 OB 20170214	14/02/2017	4,375	85.271,28
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977151	BANCAJAVAR OB 20140423	23/04/2014	V	42.386,36
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977169	BANCAJAVAR OBSUBD 20190706	06/07/2019	V	997,57
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0215307028	CA.SAGUNTO/VAR OB SUBD PERP		V	601,03
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0215307036	CA.SAGUNTO/VAR OB SUBD 20120630	30/06/2012	V	602,21
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES0214957013	CA.VITAL/10,00 OB SUBD PERP		10,000	301,44
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0214400014	CAM/VAR OB SUBD PERP		V	603,26
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0214400048	CAM/VAR OB SUBD PERP		V	600,00
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	608,70
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0264730039	CAJASUR/VAR OB SUBD 20131201	01/12/2013	V	500,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES0214987028	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20171115	15/11/2017	V	500,00
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	7.438,80
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES0214926018	SA.NOSTRA/VAR OB SUBD 20141230	30/12/2014	V	95.514,63
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES0214926026	SA.NOSTRA/VAR OB SUBD 20150318	18/03/2015	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES0214926034	SA.NOSTRA/VAR OBSUBD 20190630	30/06/2019	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950059	CA.MADRID/6,25 OB SUBD 20120410	10/04/2012	6,250	102.340,40
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950109	CA.MADRID/4,00 OB 20110302	02/03/2011	4,000	1.013,41
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950117	CA.MADRID/3,76 OB 20110331	31/03/2011	3,760	1.010,70
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950125	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20140715	15/07/2014	V	90.183,66
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950133	CA.MADRID/VAR OB 20120601	01/06/2012	V	98.232,24
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950141	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20180301	01/03/2018	V	82.519,84
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950158	CA.MADRID/VAR OB 20120209	09/02/2012	V	98.221,66
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950166	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20161017	17/10/2016	V	41.800,62
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950174	CA.MADRID/VAR OB 20140626	26/06/2014	V	994,96
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0214965024	CAN/VAR OBSUBD 20190630	30/06/2019	V	1.000,04
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT	ES0214955017	CA.ONTINYENT/VAR OB SUBD 20130528	28/05/2013	V	6.000,68
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 SEGOVIA	ES0214959076	CA.SEGOVIA/VAR OB SUBD 20170620	20/06/2017	V	47.256,91
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES0214954010	IBERCAJA/VAR OB PREF PERP		V	601,02
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES0214954028	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP		V	601,02
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES0214954036	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP		V	601,02
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES0214954044	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP		V	601,02
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES0214954135	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20180420	20/04/2018	V	450,13
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES0214954150	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20190425	25/04/2019	V	396,90
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970032	LACAIXA/VAR OB SUBD 20111010	10/10/2011	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970040	LACAIXA/VAR OB SUBD 20120412	12/04/2012	V	10,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970057	LACAIXA/VAR OB SUBD 20120722	22/07/2012	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970065	LACAIXA/VAR OBSUBD 20190228	28/02/2019	V	1.000,00
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0215474026	CA.ESPAÑA/5,75 OB SUBD 20150627	27/06/2015	5,750	988,52
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0215474166	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20181229	29/12/2018	V	923,44
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0215474190	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20151207	07/12/2015	V	95.511,56
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0215474208	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20160131	31/01/2016	V	961,97
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0215474216	CA.ESPAÑA/VAR OB 20130517	17/05/2013	V	93.186,86
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0215474224	CA.ESPAÑA/VAR OB 20140326	26/03/2014	V	91.650,00
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0215474232	CA.ESPAÑA/7,50 OBSUBD 20180828	28/08/2018	7,500	1.026,92
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981013	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD PERP		V	620,73
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981039	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20321015	15/10/2032	V	299,87
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981054	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20200628	28/06/2020	V	290,40
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981070	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20151104	04/11/2015	V	86.901,72
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES0214982110	CA.GRANADA/VAR OB SUBD 20150630	30/06/2015	V	96.813,80

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES0214982136	CA.GRANADA/VAR OBSUBD 20190316	16/03/2019	V	999,86
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983019	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP		V	301,55
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983035	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP		V	303,22
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983084	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20120801	01/08/2012	V	599,99
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983092	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20131101	01/11/2013	V	500,08
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983118	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20150412	12/04/2015	V	96.854,72
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983126	LA.CAJA/VAR OB 20111005	05/10/2011	V	98.190,00
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983134	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP		V	37.207,69
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983142	LA.CAJA/VAR OBSUBD 20190902	02/09/2019	V	50.501,12
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CR	ES0215316029	RURALCAJA/VAR OB SUBD 20151122	22/11/2015	V	87.015,27
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0214601017	CAJAMAR/VAR OB SUBD 20150316	16/03/2015	V	84.383,16
DEUTSCHE BANK, A.G.	DE0003933693	OB. DEUTSCHE BANK	10/11/2014	4,155	975,99
DEUTSCHE BANK, SOCIEDAD ANONIMA ESPAÑOLA	ES0213320015	DT.BK.SAE/VAR OB SUBD 20131230	30/12/2013	V	95,71
DEUTSCHE BANK, SOCIEDAD ANONIMA ESPAÑOLA	ES0213320023	DT.BK.SAE/VAR OB SUBD 20140331	31/03/2014	V	95,66
ENAGAS, S.A.	ES0230960009	ENG4,375 OB 20150706	06/07/2015	4,375	52.469,92
EROSKI SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429004	EROSKI/VAR OB SUBD PERP		V	25,00
EROSKI SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429038	EROSKI/VAR OB SUBD PERP		V	24,99
EUROPENNE POUR LE FINANCEMENT DE MATERIEL FER.	ES0233813163	EUROFIMA/11,00 OB 20141118	18/11/2014	11,000	8.315,93
FAGOR ELECTRODOMESTICOS, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0235972009	FAGOR/VAR OB SUBD 1ª PERP		V	24,81
FAGOR ELECTRODOMESTICOS, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0235972017	FAGOR/VAR OB SUBD 2ª PERP		V	25,05
IBERDROLA, S.A.	ES0244520138	HIDROLA/6,75 OB 20121215	15/12/2012	6,750	6,40
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	6,06
MAPFRE, S.A.	ES0224244055	MAP/6,02 OB 20110712	12/07/2011	6,020	105.701,39
MAPFRE, S.A.	ES0224244063	MAP/VAR OB SUBD 20370724	24/07/2037	V	43.208,07
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANDO DE HU	ES0217156092	EL.MONTE/VAR OB SUBD PERP		V	69.966,57
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANDO DE HU	ES0264870017	EL.MONTE/VAR OB SUBD PERP		V	1.517,22
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920029	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD PERP		V	618,10
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920045	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD PERP		V	600,86
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920052	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD PERP		V	600,93
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920060	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD 20211018	18/10/2021	V	599,84
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920078	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD 20230610	10/06/2023	V	599,90
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920086	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD 20250608	08/06/2025	V	599,86
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920094	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD 20220615	15/06/2022	V	599,83
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0213495007	SAN.CONS.FIN/VAR OB SUBD 20160928	28/09/2016	V	44.905,36
SOCIEDAD ESTATAL DE PARTICIPACIONES INDUSTRIALES	ES0202010064	SEPI/12,01 OB 20251228	28/12/2025	12,010	222.083,75
TELEFONICA, S.A.	ES0278430683	TEF/CUPCER OB 20100226	26/02/2010	C	3.140,33
UNIVERSIDAD DE VALENCIA - ESTUDI GENERAL	ES0282102005	UNIV.VAL/6,60 OB 20221215	15/12/2022	6,600	6.010,13
UNIVERSIDAD DE VALENCIA - ESTUDI GENERAL	ES0282102013	UNIV.VAL/5,55 OB 20131215	15/12/2013	5,550	6.010,13
UNIVERSIDAD POLITECNICA DE VALENCIA	ES0282103011	UPV/5,55 OB 20131215	15/12/2013	5,550	6.010,13
VIDACAIXA, S.A. DE SEGUROS Y REASEGUROS	ES0283691006	VIDACAIXA/VAR OB SUBD PERP		V	1.000,00
VIDACAIXA, S.A. DE SEGUROS Y REASEGUROS	ES0283691014	VIDACAIXA/VAR OB SUBD PERP		V	1.000,00

BONOS

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
AYT BONOS TESORERIA I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312348008	AYT.BO.TESOR.I/3,25 BTA 20100406 A	06/04/2010	3,250	100.282,12
AYT BONOS TESORERIA I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312348016	AYT.BO.TESOR.I/3,25 BTA 20100406 B	06/04/2010	3,250	98.476,67
AYT BONOS TESORERIA II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312271002	AYT.BO.TESOR.II/VAR BTA 20130224 A	24/02/2013	V	75.492,26
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298005	AYT.CCG/VAR BTA 20121214 I GTIA	14/12/2012	V	97.028,86
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298013	AYT.CCG/3,50 BTA 20160314 II GTIA	14/03/2016	3,500	96.655,33
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298021	AYT.CCG/3,75 BTA 20221214 III GTIA	14/12/2022	3,750	86.314,38
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298047	AYT.CCG/3,50 BTA 20110314 V GTIA	14/03/2011	3,500	102.151,34
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298054	AYT.CCG/4,00 BTA 20210324 VI GTIA	24/03/2021	4,000	91.421,75
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298062	AYT.CCG/VAR BTA 20170526 VII GTIA	26/05/2017	V	99.789,50
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298070	AYT.CCG/4,25 BTA 20180614 VIII GTIA	14/06/2018	4,250	98.258,23
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298088	AYT.CCG/3,75 BTA 20131025 XX GTIA	25/10/2013	3,750	100.998,77
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298096	AYT.CCG/4,25 BTA 20231025 X GTIA	25/10/2023	4,250	90.402,00
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298104	AYT.CCG/4,00 BTA 20161220 XI GTIA	20/12/2016	4,000	98.500,46
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298112	AYT.CCG/4,00 BTA 20170321 XII GTIA	21/03/2017	4,000	98.354,53
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298120	AYT.CCG/4,75 BTA 20270525 XIII GTIA	25/05/2027	4,750	93.786,98
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298138	AYT.CCG/VAR BTA 20190524 XIV GTIA	24/05/2019	V	99.781,36
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298203	AYT.CCG/4,00 BTA 20111229 XXI GTIA	29/12/2011	4,000	103.156,61
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298211	AYT.CCG/3,50 BTA 20120217 XXII GTIA	17/02/2012	3,500	101.848,88
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298229	AYT.CCG/4,75 BTA 20160615 XXIII	15/06/2016	4,750	99.483,86
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298237	AYT.CCG/4,25 BTA 20140729 XXIV GTIA	29/07/2014	4,250	102.505,68
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298245	AYT.CCG/4,50 BTA 20191202 XXV GTIA	02/12/2019	4,500	98.065,43
AYT CEDULAS CAJAS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361002001	AYT.CED.CA.III/5,25 BTA 20120628	28/06/2012	5,250	106.607,09
AYT CEDULAS CAJAS IV, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312368006	AYT.CED.CA.IV/4,00 BTA 20130313	13/03/2013	4,000	102.445,33
AYT CEDULAS CAJAS IX, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312358007	AYT.CED.CA.IX/3,75 BTA 20150331 A	31/03/2015	3,750	99.483,86
AYT CEDULAS CAJAS IX, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312358015	AYT.CED.CA.IX/4,00 BTA 20200331 B	31/03/2020	4,000	91.417,27
AYT CEDULAS CAJAS V, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0307148019	AYT.CED.CA.V/4,75 BTA 20181204 B	04/12/2018	4,750	101.200,90
AYT CEDULAS CAJAS VI, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312360003	AYT.CED.CA.VI/4,00 BTA 20140407 A	07/04/2014	4,000	101.823,74
AYT CEDULAS CAJAS VII, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312361001	AYT.CED.CA.VII/4,00 BTA 201101623	23/06/2011	4,000	103.092,90
AYT CEDULAS CAJAS VIII, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312362009	AYT.CED.CA.VIII/4,00 BTA 20141118 A	18/11/2014	4,000	100.833,90
AYT CEDULAS CAJAS VIII, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312362017	AYT.CED.CA.VIII/4,25 BTA 20191118 B	18/11/2019	4,250	95.689,77
AYT CEDULAS CAJAS X, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312342019	AYT.CED.CA.X/3,75 BTA 20250630 B	30/06/2025	3,750	81.271,37
AYT CEDULAS CAJAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0352961009	AYT.CED.CA/5,25 BTA 20110420	20/04/2011	5,250	104.490,60
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A.	ES0312273487	COLAT.GLB.HIP./VAR BTA 20480325 A	25/03/2048	V	91.644,34
AYT DEUDA SUBORDINADA I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312284021	AYT.DEU.SUBD/VAR BTA 20161117 C	17/11/2016	V	33.215,00
AYT FONDO EOLICO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312376009	AYT.EOLICO/VAR BTA 20141125 E1 GTIA	25/11/2014	V	490,15
AYT FONDO EOLICO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312376017	AYT.EOLICO/VAR BTA 20161229 E2 GTIA	29/12/2016	V	490,00
AYT FTGENCAT I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0356848020	AYT.FTGENCAT I/VAR BTA 20340905 BG	05/09/2034	V	71.218,15
AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0307150015	AYT.GEN.H.IV/VAR BTH 20360516 B	16/05/2036	V	69.817,80
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0312349014	AYT.GEN.H.VI/VAR BTH 20380115 A2	15/01/2038	V	79.124,51
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0312285002	AYT.GEN.H.XII/VAR BTH 20510315 A	15/03/2051	V	31.419,06
AYT HIPOTECARIO MIXTO IV, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0307152003	AYT.HIP.MIX.IV/VAR BTA 20400120 A	20/01/2040	V	48.352,10
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312252002	AYT.HIP.MIX.V/VAR BTA 20410610 A	10/06/2041	V	57.387,31
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0307154017	KUTXA.HIP.II/VAR BTA 20561015 B	15/10/2056	V	59.116,33
AYT PRESTAMOS CONSUMO III, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312372016	AYT.PREST.C.III/VAR BTA 20210115 B	15/01/2021	V	78.871,29
AYT.11, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0338541008	AYT.11/VAR BTH 20351015 A GTIA	15/10/2035	V	26.821,50
AYT.11, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0338541016	AYT.11/VAR BTH 20351015 B GTIA	15/10/2035	V	68.997,04
BANCAJA 10, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312872015	BANCAJA10/VAR BTA 20500522 A2 GTIA	22/05/2050	V	69.670,82
BANCAJA 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312867007	BANCAJA.11/VAR BTA 20500427 A1 GTIA	27/01/2010	V	5.901,96
BANCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0312883004	BANCAJA.4/VAR BTH 20340618 A GTIA	18/06/2034	V	24.010,90
BANCAJA 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312885017	BANCAJA.6/VAR BTA 20360220 A2 GTIA	20/02/2036	V	28.710,91
BANCAJA 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312885025	BANCAJA.6/VAR BTA 20360220 B GTIA	20/02/2036	V	52.961,35
BANCAJA 8, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312887005	BANCAJA.8/VAR BTA 20371025 A GTIA	25/10/2037	V	39.875,39
BANCAJA 8, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312887013	BANCAJA.8/VAR BTA 20371025 B GTIA	25/10/2037	V	65.583,33
BANCAJA 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312888011	BANCAJA.9/VAR BTA 20430925 A2 GTIA	25/09/2043	V	49.301,10
BANCAJA 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312888029	BANCAJA.9/VAR BTA 20430925 B GTIA	25/09/2043	V	99.985,71
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211213	BBVA/VAR BO 20110622	22/06/2011	V	49.917,88
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211304	BBVA/5,00 BOSUBDCONV 20141015	15/10/2014	5,000	1.003,72
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0313377014	BCO.COOP.ESP/3,125 BO 20120402 GTIA	02/04/2012	3,125	51.221,06
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0313377022	BCO.COOP.ESP/2,42 BO 20121015 GTIA	15/10/2012	2,420	50.000,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860092	SAB/VAR BO 20100920	20/09/2010	V	99.537,22
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860134	SAB/VAR BO 20111026	26/10/2011	V	98.573,72
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860175	SAB/VAR BOESTR 20110310	10/03/2011	V	42.972,47
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860233	SAB/4,375 BO 20120522	22/05/2012	4,375	103.718,19
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860241	SAB/VAR BOSUBDCONV 20130721	21/07/2013	V	969,30
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860258	SAB/VAR BO 20120220	20/02/2012	V	49.888,06
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0313980015	BVA/VAR BO 20110721	21/07/2011	V	47.008,19
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0313980023	BVA/VAR BO 20120223	23/02/2012	V	45.822,95
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0313580120	GUI/VAR BO 20110321	21/03/2011	V	97.268,98
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0313580138	GUI/2,375 BO 20121125 GTIA	30/11/2012	2,375	49.966,14
BANCO PASTOR, S.A.	ES0313770069	PAS/VAR BO 20100121	21/01/2010	V	99.986,79
BANCO PASTOR, S.A.	ES0313770077	PAS/3,00 BO 20120302 GTIA	02/03/2012	3,000	50.991,28
BANCO PASTOR, S.A.	ES0313770085	PAS/VAR BO 20121203 GTIA	03/12/2012	V	50.000,00
BANCO PASTOR, S.A.	ES0313770093	PAS/VAR BO 20111223 CREC	23/12/2011	V	100.000,00
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0313790000	POP/3,00 BO 20120223 GTIA	23/02/2012	3,000	51.121,86
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0313790026	POP/3,00 BO 20120424 GTIA	24/04/2012	3,000	50.948,46
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0313260053	BCH/VAR BO SUBD 20110527	27/05/2011	V	6,81
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0313540025	BBE/VAR BO 20100222	22/02/2010	V	99.943,41
BANKINTER 13 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313270029	BKT.13/VAR BTA 20490717 B GTIA	17/07/2049	V	67.139,62
BANKINTER 15 FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313272025	BKT.15/VAR BTH 20501020 A3 GTIA	20/10/2050	V	60.620,34
BANKINTER 2 PYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313716013	BKT.2.PYME/VAR BTA 20430516 A2 GTIA	16/05/2043	V	42.722,07
BANKINTER 4, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313919005	BKT.4/VAR BTH 20381112 A GTIA	12/11/2038	V	33.613,53
BANKINTER 4, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313919021	BKT.4/VAR BTH 20381112 C GTIA	12/11/2038	V	81.785,00
BANKINTER 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313814065	BKT.9/VAR BTA 20420716 BT GTIA	16/07/2042	V	81.482,56
BANKINTER, S.A.	ES0313679427	BKT/VAR BO 20101118	18/11/2010	V	99.596,29
BANKINTER, S.A.	ES0313679435	BKT/VAR BO 20110601	01/06/2011	V	99.080,55

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANKINTER, S.A.	ES0313679443	BKT/VAR BO 20120621	21/06/2012	V	97.647,83
BANKINTER, S.A.	ES0313679450	BKT/3.00 BO 20120224 GTIA	24/02/2012	3,000	102.049,68
BANKINTER, S.A.	ES0313679476	BKT/VAR BO 20120615 II GTIA	15/06/2012	V	727.026,80
BBVA CONSUMO 3 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313719009	BBVA.CONSUMO.3/VAR BTA 20220222 A	22/02/2022	V	52.134,75
BBVA CONSUMO 4 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313523005	BBVA.CONSUMO.4/VAR BTA 20230623 A	23/06/2023	V	99.985,42
BBVA CONSUMO 4 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313523013	BBVA.CONSUMO.4/VAR BTA 20230623 B	23/06/2023	V	99.978,47
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467175	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20140331 18	31/03/2014	V	52.040,62
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467308	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20141111 33	11/11/2014	V	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467316	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20121112 34	12/11/2012	V	49.200,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467324	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20141127 35	27/11/2014	V	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467332	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20121203 36	03/12/2012	V	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467340	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121207	07/12/2012	C	49.478,82
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467357	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121203	03/12/2012	C	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467365	BBVA.SR.FIN/5,00 BOESTR 20141201 39	01/12/2014	5,000	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467373	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121203	03/12/2012	C	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467381	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20121207 41	07/12/2012	V	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467399	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20141210 42	10/12/2014	V	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467407	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121210	10/12/2012	C	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467415	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121224	24/12/2012	C	49.416,67
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467423	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121214	14/12/2012	C	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467431	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121217	17/12/2012	C	49.625,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467449	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20121218 48	18/12/2012	V	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467464	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121217	17/12/2012	C	50.000,17
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467472	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121224	24/12/2012	C	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467480	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20121224 52	24/12/2012	V	50.000,00
BBVA-3 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0310110020	BBVA3-PYME/VAR BTA 20280421 B GTIA	21/04/2028	V	37.980,37
BBVA-4 PYME, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370458012	BBVA4.PYME/VAR BTA 20380819 A2 GTIA	19/08/2038	V	18.491,04
BBVA-6 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370460000	BBVA6.PYME/VAR BTA 20460322 A1	22/03/2046	V	32.235,64
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080052	BPEF/VAR BO 20100526	26/05/2010	V	99.906,36
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080086	BPEF/VAR BO 20110118	18/01/2011	V	99.466,67
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080136	BPEF/VAR BO 20100728	28/07/2010	V	99.525,00
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080144	BPEF/VAR BO 20120208	08/02/2012	V	98.357,23
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080169	BPEF/VAR BO 20100726	26/07/2010	V	99.614,98
CABILDO INSULAR DE TENERIFE	ES0301330082	CBDO.TEN/0,75 BO 20121214	14/12/2012	0,750	1.000,00
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0314958010	CAIXANOVA/VAR BO 20101123	23/11/2010	V	97.556,35
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0314958028	CAIXANOVA/VAR BO 20110314	14/03/2011	V	49.468,85
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0314958036	CAIXANOVA/VAR BO 20120302	02/03/2012	V	48.830,00
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0314958044	CAIXANOVA/VAR BO 20110604	04/06/2011	V	50.775,00
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0314958051	CAIXANOVA/3,125 BO 20120319 GTIA	19/03/2012	3,125	51.126,99
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840077	CA.CATALUNYA/VAR BO 20100302	02/03/2010	V	99.940,31
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840101	CA.CATALUNYA/VAR BO 20110718	18/07/2011	V	97.649,56
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840143	CA.CATALUNYA/VAR BO 20100125	25/01/2010	V	49.967,77
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840168	CA.CATALUNYA/3,00 BO 20120305 GTIA	05/03/2012	3,000	50.969,70
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840176	CA.CATALUNYA/3,00 BO 20120507 GTIA	07/05/2012	3,000	51.019,80
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840184	CA.CATALUNYA/3,00 BO 20141029 GTIA	29/10/2014	3,000	49.863,21
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840192	CA.CATALUNYA/VAR BO 20141204 GTIA	04/12/2014	V	50.000,00
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0313249049	CA.GIRONA/3,09 BO 20120619 GTIA	19/06/2012	3,090	50.981,14
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0313249056	CA.GIRONA/2,512 BO 20121026 GTIA	26/10/2012	2,512	50.017,73
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0313249064	CA.GIRONA/VAR BO 20141214 GTIA	14/12/2014	V	50.000,00
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0314850035	CA.MANRESA/VAR BO 20110714	14/07/2011	V	97.450,00
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0314973084	CA.SABADELL/3,00 BO 20120604 GTIA	04/06/2012	3,000	50.803,00
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0314973100	CA.SABADELL/3,239 BO 20141113 GTIA	13/11/2014	3,239	50.000,00
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0314973118	CA.SABADELL/3,111 BO 20141127 GTIA	27/11/2014	3,111	50.000,00
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0315346009	CA.TARRAGONA/VAR BO 20110411	11/04/2011	V	97.980,00
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0315346025	CA.TARRAGONA/VAR BO 20111024 GTIA	24/10/2011	V	49.722,05
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0315346041	CA.TARRAGONA/VAR BO 20111204 GTIA	04/12/2011	V	50.595,00
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0315346058	CA.TARRAGONA/3,00 BO 20120615 GTIA	15/06/2012	3,000	50.813,00
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0314974041	CA.TERRASSA/VAR BO 20120605 GTIA	05/06/2012	V	50.944,53
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0314966062	CA.PENEDES/6,50 BO 20100721	21/07/2010	6,500	51.637,50
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0314966096	CA.PENEDES/1,796 BO 20100416 GTIA	16/04/2010	1,796	50.158,67
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0314966104	CA.PENEDES/1,85 BO 20100603 GTIA	03/06/2010	1,850	50.157,62
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0314966120	CA.PENEDES/VAR BO 20111118 GTIA	18/11/2011	V	49.843,36
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0314966161	CA.PENEDES/VAR BO 20120717 GTIA	17/07/2012	V	50.246,67
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0314846041	CA.LAIETANA/2,91 BO 20120605 GTIA	05/06/2012	2,910	50.714,50
CAIXA PENEDES 1 TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313252001	CA.PENEDES1.TDA/VAR BTA 20430128 A	28/01/2043	V	61.101,46
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACI	ES0357326000	PENEDES.PYMES.1/VAR BTA 20450928 A	28/09/2045	V	49.071,57
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0314826043	CAJASTUR/VAR BO 20121214 GTIA	14/12/2012	V	50.000,00
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0314826050	CAJASTUR/VAR BO 20121214 GTIA	14/12/2012	V	50.000,00
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0315424004	CCM/6,50 BO 20100624	24/06/2010	6,500	50.615,58
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843212	CAIXAGALICIA/VAR BO 20101129	29/11/2010	V	99.111,87
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843238	CAIXAGALICIA/VAR BO 20111108	08/11/2011	V	49.063,17
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843261	CAIXAGALICIA/VAR BO 20100110	10/01/2010	V	50.039,18
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843303	CAIXAGALICIA/3,25 BO 20120417 GTIA	17/04/2012	3,250	51.200,32
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843329	CAIXAGALICIA/3,00 BO 20141103 GTIA	03/11/2014	3,000	49.663,44
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES0315530032	CA.RIOJA/VAR BO 20100315	15/03/2010	V	96.265,79
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0314600083	CA.MURCIA/6,00 BO 20100604	04/06/2010	6,000	51.015,00
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0314600133	CA.MURCIA/VAR BO 20111017 GTIA	17/10/2011	V	50.437,83
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0314854086	CAJADUERO/2,451 BO 20121009 GTIA	09/10/2012	2,451	49.961,16
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0314975006	CA.CANTABRIA/VAR BO 20100406	06/04/2010	V	98.321,50
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0314975014	CA.CANTABRIA/VAR BO 20110330	30/03/2011	V	49.149,42
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977101	BANCAJA/3,95 BO 20110430	30/04/2011	3,950	600,17
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977119	BANCAJA/3,95 BO 20110601	01/06/2011	3,950	600,13
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977168	BANCAJA/VAR BO 20100110	10/01/2010	V	600,17
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977218	BANCAJA/VAR BO 20100225	25/02/2010	V	99.638,11
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977242	BANCAJA/VAR BO 20110510	10/05/2011	V	96.209,99

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977259	BANCAJAVAR BO 20120124	24/01/2012	V	92.947,96
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977267	BANCAJAVAR BO 20120321	21/03/2012	V	90.621,94
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977275	BANCAJA/3,00 BO 20120312 GTIA	12/03/2012	3,000	50.967,68
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977283	BANCAJAVAR BO 20120318 GTIA	18/03/2012	V	50.748,10
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977309	BANCAJAVAR BO 20110325 GTIA	25/03/2011	V	49.688,66
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977325	BANCAJA/3,00 BO 20120511 GTIA	11/05/2012	3,000	50.881,64
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977341	BANCAJA/2,375 BO 20120918 GTIA	18/09/2012	2,375	49.919,82
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977358	BANCAJA/3,00 BO 20141027 GTIA	27/10/2014	3,000	49.925,18
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES0315308173	CA.VITAL/VAR BO 20100331	31/03/2010	V	50.015,31
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES0315308181	CA.VITAL/1,838 BO 20100331 GTIA	31/03/2010	1,838	50.143,59
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES0315308199	CA.VITAL/VAR BO 20120323	23/03/2012	V	49.997,58
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES0315308207	CA.VITAL/2,479 BO 20120924 GTIA	24/09/2012	2,479	49.926,90
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400054	CAM/VAR BO 20100114	14/01/2010	V	99.800,33
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400062	CAM/VAR BO 20110203	03/02/2011	V	98.045,99
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400070	CAM/VAR BO 20120515	15/05/2012	V	1.000,04
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400088	CAM/VAR BO 20120412	12/04/2012	V	99.965,04
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400096	CAM/3,125 BO 20120326 GTIA	26/03/2012	3,125	51.182,92
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400104	CAM/3,25 BO 20120427 GTIA	27/04/2012	3,250	51.182,58
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400112	CAM/VAR BO 20111108 GTIA	08/11/2011	V	49.821,70
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400120	CAM/2,875 BO 20120514 GTIA	14/05/2012	2,875	50.859,44
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400187	CAM/3,00 BO 20141112 GTIA	12/11/2014	3,000	49.844,78
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400195	CAM/VAR BO 20141201 GTIA	01/12/2014	V	50.000,00
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES0314961063	CA.BURGOS/VAR BO 20110131	31/01/2011	V	98.669,70
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0314910029	CA.AVILA/VAR BO 20100629	29/06/2010	V	49.915,10
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0314910037	CA.AVILA/VAR BO 20101029	29/10/2010	V	50.209,81
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0314910045	CA.AVILA/VAR BO 20120430 GTIA	30/04/2012	V	50.694,09
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0314910060	CA.AVILA/VAR BO 20120409 CREC	09/04/2012	V	50.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0314910078	CA.AVILA/VAR BO 20111009	09/10/2011	V	50.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0364730004	CAJASUR/VAR BO 20100118	18/01/2010	V	50.009,85
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES0314926009	SA.NOSTRA/6,50 BO 20100728	28/07/2010	6,500	51.602,50
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES0314926025	SA.NOSTRA/3,00 BO 20141210 GTIA	10/12/2014	3,000	49.979,08
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950074	CA.MADRID/4,9089 BO SUBD 20100406	06/04/2010	4,909	603,07
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950215	CA.MADRID/VAR BO 20100323	23/03/2010	V	99.869,92
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950280	CA.MADRID/VAR BO 20100524	24/05/2010	V	99.838,28
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950348	CA.MADRID/5,125 BO 20110411	11/04/2011	5,125	51.934,11
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950363	CA.MADRID/VAR BO 20100625	25/06/2010	V	50.020,70
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950371	CA.MADRID/VAR BOESTR 20100728	28/07/2010	V	43.266,59
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950389	CA.MADRID/VAR BOESTR 20100802	02/08/2010	V	43.426,70
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950397	CA.MADRID/VAR BO 20101015 CREC	15/10/2010	V	49.997,81
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950447	CA.MADRID/3,65 BO 20100728	28/07/2010	3,650	50.680,91
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950454	CA.MADRID/3,125 BO 20120220 GTIA	20/02/2012	3,125	51.237,88
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950470	CA.MADRID/2,875 BO 20120416 GTIA	16/04/2012	2,875	50.833,34
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950488	CA.MADRID/3,245 BO 20101008	08/10/2010	3,245	50.674,04
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950504	CA.MADRID/3,00 BO 20101022	22/10/2010	3,000	50.564,84
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950520	CA.MADRID/2,65 BO 20101108	08/11/2010	2,650	50.400,79
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950538	CA.MADRID/3,625 BO 20110629 GTIA	29/06/2011	3,625	50.983,70
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950546	CA.MADRID/VAR BO 20111123 CREC	23/11/2011	V	50.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0314965007	CAN/5,75 BO 20100527	27/05/2010	5,750	101.631,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0314965031	CAN/VAR BO 20110310 GTIA	10/03/2011	V	50.260,41
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0314965042	CA.SEGOVIA/2,595 BO 20100518 GTIA	18/05/2011	2,595	50.691,83
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0314965059	CA.SEGOVIA/VAR BO 20110518 GTIA	18/05/2011	V	49.843,36
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0314965075	CA.SEGOVIA/2,50 BO 20121026 GTIA	26/10/2012	2,500	49.960,45
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO CATOLIC	ES0315134009	CAJACIRCULO/VAR BO 20120308	08/03/2012	V	48.575,38
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0314970098	LACAIXA/3,375 BO 20120203 GTIA	03/02/2012	3,375	51.530,62
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0315474405	CA.ESPAÑA/VAR BO 20100330	30/03/2010	V	998,21
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0315474421	CA.ESPAÑA/VAR BO 20101214	14/12/2010	V	96.585,98
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0315474447	CA.ESPAÑA/VAR BO 20121122	22/11/2012	V	943,08
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0315474454	CA.ESPAÑA/3,004 BO 20120615 GTIA	15/06/2012	3,004	50.818,00
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0314981053	CAJACANARIAS/VAR BO 20120316 GTIA	16/03/2012	V	50.811,42
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES0314982002	CA.GRANADA/VAR BO 20120308	08/03/2012	V	48.625,00
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES0314982010	CA.GRANADA/6,625 BO 20100714	14/07/2010	6,625	51.637,50
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0314983026	LA.CAJA/VAR BO 20100915	15/09/2010	V	49.153,48
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0314983059	LA.CAJA/VAR BO 20110518 GTIA	18/05/2011	V	50.400,17
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0314983091	LA.CAJA/3,159 BO 20140509 GTIA	09/05/2014	3,159	49.975,20
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0314601016	CAJAMAR/VAR BO 20110714	14/07/2011	V	49.951,54
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0314601024	CAJAMAR/3,125 BO 20120330 GTIA	30/03/2012	3,125	51.091,00
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0314601032	CAJAMAR/VAR BO 20110331 GTIA	31/03/2011	V	49.976,63
CAP-TDA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0315911000	CAP-TDA.1/VAR BTA 20130912 GTIA	12/09/2013	V	96.520,90
CEAMI GUARANTEED BONDS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACT	ES0315944001	CEAMI.BONDS.I/3,125 BTA 20120622	22/06/2012	3,125	51.044,70
CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 2, FONDO DE TITULIZACION	ES0318821008	CED.POP.2/3,375 BTA 20110412 GTIA	12/04/2011	3,375	102.383,29
CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 3, FONDO DE TITULIZACION	ES0318822006	CED.POP.3/4,25 BTA 20170426 GTIA	26/04/2017	4,250	100.248,48
CEDULAS TDA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0317018002	CED.TDA.1/3,25 BTA 20100619 1 GTIA	19/06/2010	3,250	100.998,10
CEDULAS TDA 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0318824002	CED.TDA.11/VAR BTA 20120601 A GTIA	01/06/2010	V	40.000,00
CEDULAS TDA 14, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0318827005	CED.TDA.14/3,25 BTA 20130715 A1	15/07/2013	3,250	32.078,84
CEDULAS TDA 15, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0318828003	CED.TDA.15/3,25 BTA 20130603 GTIA	03/06/2013	3,250	47.516,97
CEDULAS TDA 17, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0316989005	CED.TDA.17/3,125 BTA 20130923 A	23/09/2013	3,125	50.000,00
CEDULAS TDA 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0317019000	CED.TDA.2/4,50 BTA 20131126 GTIA	26/11/2013	4,500	104.247,34
CEDULAS TDA 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0317043000	CED.TDA.3/4,38 BTA 20160303 1 GTIA	03/03/2016	4,375	101.234,18
CEDULAS TDA 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0317045005	CED.TDA.5/4,13 BTA 20191129 A GTIA	29/11/2019	4,125	93.680,82
CEDULAS TDA 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0317047001	CED.TDA.7/3,50 BTA 20170620 GTIA	20/06/2017	3,500	94.486,75
CONSUMO BANCAJA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0323633000	CONS.BANCAJA.1/VAR BTA 20200526 A	26/05/2020	V	34.320,91
CRITERIA CAIXACORP, S.A.	ES0340609009	CRI/4,125 BO 20141120	20/11/2014	4,125	49.815,84
EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 3, FONDO DE TITULIZACION	ES0330876014	TDA.CAM.3/VAR BTA 20400128 A2 GTIA	28/01/2040	V	64.463,72
ENAGAS, S.A.	ES0330960008	ENG/3,25 BO 20120706	06/07/2012	3,250	51.293,08
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0330991003	ELE.CAP/VAR BO 20120705	05/07/2012	V	49.623,88

Nombre del emisor	ISIN	Nombre de Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
ENTE PUBLICO RTVE	ES0331163107	RTVE/VAR BO 20100429	29/04/2010	V	199.959,15
F.T.A. PROGRAMA INDEPENDIENTE DE TITULIZ. DE CED. HIPOTE	ES0334699008	PRG.IND.CED.HIP/5, 125 BTA 20220720	20/07/2022	5,125	99.912,96
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER AUTO 1	ES0382040006	SAN.AUTO1/VAR BTA 20211125 GTIA	25/11/2021	V	11.364,57
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER CONSUMER	ES0338057005	SAN.CONS.AUTO06/VAR BTA 20161020 A	20/10/2016	V	41.800,60
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER CONSUMER	ES0337709002	SAN.AUTO.07-1/VAR BTA 20220920 A	20/09/2022	V	54.216,49
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMPRESAS ;	ES0338058045	SAN.EMPR.2/VAR BTA 20500623 D GTIA	23/06/2050	V	63.959,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER FINANCIACI	ES0382043000	SAN.FINAN.1/VAR BTA 20350720 A GTIA	20/07/2035	V	29.290,24
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIPOTECARI	ES0382042002	SAN.HIP.2/VAR BTA 20490118 A GTIA	18/01/2049	V	54.786,56
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIPOTECARI	ES0338093026	SAN.HIP.3/VAR BTA 20500118 A3 GTIA	18/01/2050	V	84.203,57
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIPOTECARI	ES0338093067	SAN.HIP.3/VAR BTA 20500118 E GTIA	18/01/2050	V	95.725,33
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 11	ES0338340005	UCI.11/VAR BTA 20410915 A GTIA	15/09/2041	V	27.281,31
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 11	ES0338340021	UCI.11/VAR BTA 20410915 C GTIA	15/09/2041	V	68.300,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 14	ES0338341003	UCI.14/VAR BTA 20430620 A GTIA	20/06/2043	V	39.628,15
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 16	ES0338186010	UCI.16/VAR BTA 20490616 A2 GTIA	16/06/2049	V	64.303,40
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 18	ES0337986006	UCI.18/VAR BTA 20501216 A GTIA	16/12/2050	V	56.054,72
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 8	ES0338446000	UCI.8/VAR BTA 20331218 A GTIA	18/12/2033	V	15.711,15
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 9	ES0338222005	UCI.9/VAR BTA 20350619 A GTIA	19/06/2035	V	19.293,57
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, HIPOTEBANSA 11	ES0338447008	HIPOTEBANSA.11/VAR BTA 20350215 A	15/02/2035	V	27.969,69
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, SANTANDER EMPRESAS	ES0337710018	SAN.EMPR.3/VAR BTA 20491016 A2 GTIA	16/10/2049	V	47.165,15
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, UCI 15	ES0380957003	UCI.15/VAR BTA 20481216 A GTIA	18/12/2048	V	46.259,69
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, UCI 17	ES0337985016	UCI.17/VAR BTA 20491217 A2 GTIA	17/12/2049	V	60.000,00
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 10	ES0338146006	UCI.10/VAR BTH 20360622 A GTIA	22/06/2036	V	27.573,15
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 12	ES0338147004	UCI.12/VAR BTH 20391215 A GTIA	15/12/2039	V	32.871,48
FTPYME BANCAJA 3 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0304501044	PYME.BANCAJA.3/VAR BTA 20371213 C	13/12/2037	V	42.659,11
FTPYME BANCAJA 4 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339731020	PYME.BANCAJA.4/VAR BTA 20380724 A3G	24/07/2038	V	35.533,73
FTPYME BANCAJA 4 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339731038	PYME.BANCAJA.4/VAR BTA 20380724 B	24/07/2038	V	87.000,00
FTPYME BANCAJA 4 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339731053	PYME.BANCAJA.4/VAR BTA 20380724 D	24/07/2038	V	99.854,41
FTPYME TDA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339752000	FTPYME.TDA.4/VAR BTA 20350726 1SA	26/07/2035	V	4.249,07
FTPYME TDA 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339741011	FTPYME.TDA.5/VAR BTA 20371026 2CA	26/10/2037	V	85.026,10
FTPYME TDA BANCA MARCH, FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0339753016	PYME.TDA.MARCH/VAR BTA 20360926 2CA	26/09/2036	V	52.024,99
FTPYME TDA CAM 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339758007	PYME.TDA.CAM.2/VAR BTA 20420726 1SA	26/07/2042	V	3.885,00
FTPYME TDA CAM 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339759013	PYME.TDA.CAM.4/VAR BTA 20450928 A2	28/09/2045	V	39.904,97
FTPYME TDA SABADELL 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0339844013	PYME.TDA.SAB.2/VAR BTA 20230126 1SA	26/01/2023	V	21.730,58
GAT FTGENCAT 2007, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0341081018	GAT.GENCAT.07/VAR BTA 20491215 A2G	15/12/2049	V	99.773,00
GAT FTGENCAT 2007, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0341081026	GAT.GENCAT.07/VAR BTA 20491215 B	15/12/2049	V	71.058,00
GAT FTGENCAT 2008, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0341071027	GAT.GENCAT.08/VAR BTA 20480128 B	28/01/2048	V	67.089,00
GAT FTGENCAT 2009, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0341064006	GAT.GENCAT.09/VAR BTA 20470120 A1G	20/01/2047	V	100.000,00
GC FTPYME PASTOR 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0316873001	GC.PYME.PAS.1/VAR BTA 20231015 AS	15/10/2023	V	2.948,15
GC FTPYME SABADELL 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0341169003	GC.PYME.SAB.4/VAR BTA 20380430 AS	30/04/2038	V	10.546,81
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0332235011	GC.PAS.HIP.5/VAR BTA 20460630 A2	30/06/2046	V	85.597,70
HIPOCAT 10, F.T.A.	ES0345671038	HIPOCAT.10/VAR BTA 20120424 A4 GTIA	24/04/2012	V	90.891,84
HIPOCAT 14, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345674016	HIPOCAT.14/VAR BTA 20501215 B GTIA	15/12/2050	V	68.239,36
HIPOCAT 16, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345676011	HIPOCAT.16/VAR BTA 20510315 B GTIA	15/03/2051	V	61.853,22
HIPOCAT 17, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345677001	HIPOCAT.17/VAR BTA 20520920 A GTIA	20/09/2052	V	85.587,69
HIPOCAT 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345721015	HIPOCAT.9/VAR BTA 20380715 A2A GTIA	15/07/2038	V	69.962,96
HIPOCAT 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345721023	HIPOCAT.9/VAR BTA 20380715 A2B GTIA	15/07/2038	V	62.194,40
HIPOCAT 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345721049	HIPOCAT.9/VAR BTA 20380715 C GTIA	15/07/2038	V	76.774,78
IM CAJA LABORAL 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347552004	IM.CA.LABORAL.2/VAR BTA 20510124 A	24/01/2051	V	91.033,37
IM CEDULAS 1 GRUPO BANCO POPULAR, FONDO DE TITULIZACI	ES0347858005	IM.CEDULAS.1/4,25 BTA 20140212 GTIA	12/02/2014	4,250	101.865,91
IM CEDULAS 10, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0349045007	IM.CED.10/4,50 BTA 20220221 GTIA	21/02/2022	4,500	94.739,95
IM CEDULAS 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347852008	IM.CED.3/4,00 BTA 20141119 GTIA	19/11/2014	4,000	100.640,96
IM CEDULAS 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347848006	IM.CED.4/3,75 BTA 20150311 A GTIA	11/03/2015	3,750	99.360,07
IM CEDULAS 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347784003	IM.CED.7/4,00 BTA 20210331 GTIA	31/03/2021	4,000	91.814,58
IM CEDULAS 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347785000	IM.CED.9/4,25 BTA 20160809 GTIA	09/06/2016	4,250	100.071,35
IM FTGENCAT SABADELL 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0347842017	IM.GENCAT.SAB.2/VAR BTA 20281116 AG	16/11/2028	V	99.896,00
IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, FONDO DE TITULIZAC	ES0347843049	IM.POP.EMP.1/VAR BTA 20330321 D	21/03/2033	V	67.879,54
IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I FONDO DE TITULIZACION	ES0347844070	IM.POP.PYME.I/VAR BTA 20390921 D	21/09/2039	V	77.502,31
IM PASTOR 3, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0347862007	IM.PAS.3/VAR BTH 20430322 A GTIA	22/03/2043	V	36.345,78
IM PASTOR 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347854004	IM.PAS.4/VAR BTA 20440322 A GTIA	22/03/2044	V	44.744,62
IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0347787014	IM.PREST.F.CED./VAR BTA 20220124 B	24/01/2022	V	58.864,26
IM TERRASSA 1 FTGENCAT FTA	ES0347863039	IM.TERR.1/VAR BTA 20500424 C GTIA	24/04/2050	V	91.587,15
IM TERRASSA 1 FTGENCAT FTA	ES0347863047	IM.TERR.1/VAR BTA 20500424 D GTIA	24/04/2050	V	91.586,24
IM TERRASSA MBS 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347855001	IM.TERR.MBS.1/VAR BTA 20490724 A	24/07/2049	V	47.388,07
INTERMONEY MASTER CEDULAS, FONDO DE TITULIZACION DE A	ES0362859003	INTER.MAST.CED/3,50 BTA 20151202 M1	02/12/2015	3,500	96.733,77
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE CREDIT	ES0317617027	LICO.LEASING/2,656 BO 20121126 GTIA	26/11/2012	2,656	50.000,00
MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359092014	MADRID.RMBS.II/VAR BTA 20490822 A2	22/08/2049	V	47.868,93
MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359092030	MADRID.RMBS.II/VAR BTA 20490822 B	22/08/2049	V	47.297,06
MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359092048	MADRID.RMBS.III/VAR BTA 20490822 C	22/08/2049	V	41.982,81
MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359093012	MADRID.RMBS.III/VAR BTA 20500222 A2	22/02/2050	V	73.516,13
MBS BANCAJA 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361795000	MBS.BANCAJA.2/VAR BTA 20380225 A	25/02/2038	V	35.481,38
MBS BANCAJA 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361796016	MBS.BANCAJA.3/VAR BTA 20431226 A2	26/12/2043	V	51.563,24
MBS BANCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361797014	MBS.BANCAJA.4/VAR BTA 20500723 A2	23/07/2050	V	59.270,91
MBS BANCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361797048	MBS.BANCAJA.4/VAR BTA 20500723 C	23/07/2050	V	64.000,00
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANDO DE HU	ES0358197012	CAJASOL/3,125 BO 20120427 GTIA	27/04/2012	3,125	51.103,40
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES0364872087	UNICAJA/5,375 BO 20100521	21/05/2010	5,375	51.150,00
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES0364872095	UNICAJA/3,00 BO 20120618 GTIA	18/06/2012	3,000	50.957,92
POPULAR CAPITAL, S.A.	ES0370412001	POP.CAP./VAR BOSUBDCANJ 20131023	23/10/2013	V	978,86
PROGRAMA CEDULAS TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0371622004	PROG.CED.TDA/VAR BTA 20160408 A1	08/04/2016	V	91.000,00
PROGRAMA CEDULAS TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0371622012	PROG.CED.TDA/4,13 BTA 20121014 A4	10/04/2021	4,125	93.334,00
PROGRAMA CEDULAS TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0371622020	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20131014 A6	10/04/2031	4,250	84.467,86
PROGRAMA CEDULAS TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0371622046	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20270328 A5	28/03/2027	4,250	86.802,00
PYME BANCAJA 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0372259038	PYME.BANCAJA.5/VAR BTA 20390214 B	14/02/2039	V	63.000,00
PYME VALENCIA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0372241010	PYME.VALENCIA1/VAR BTA 20400323 A2	23/03/2040	V	43.585,70
PYMES BANESTO 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0372260010	PYMES.BTO.2/VAR BTA 20311231 A2	31/12/2031	V	83.204,22
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA	ES0374273003	RURAL.HIP.GBL.I/VAR BTA 20390118 A	18/01/2039	V	44.590,63

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
RURAL HIPOTECARIO IX, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0374274019	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 A2	17/02/2050	V	73.173,34
RURAL HIPOTECARIO IX, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0374274043	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 C	17/02/2050	V	52.363,97
RURAL HIPOTECARIO V FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0358284000	RURAL.HIP.V/VAR BTH 20350315 A1	15/03/2035	V	29.428,38
RURAL HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0366366005	RURAL.HIP.VII/VAR BTA 20380315 A1	15/03/2038	V	38.369,36
RURAL HIPOTECARIO VIII, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0366367029	RURAL.HIP.VIII/VAR BTA 20440119 A2B	19/01/2044	V	70.333,83
RURAL HIPOTECARIO VIII, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0366367045	RURAL.HIP.VIII/VAR BTA 20440119 C	19/01/2044	V	64.841,38
RURAL HIPOTECARIO VIII, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0366367060	RURAL.HIP.VIII/VAR BTA 20440119 E	19/01/2044	V	49.947,33
RURAL HIPOTECARIO XI, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0323975005	RURAL.HIP.XI/VAR BTA 20530325 A	25/03/2053	V	59.340,67
RURAL HIPOTECARIO XII, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0323976003	RURAL.HIP.XII/VAR BTA 20530622 A	22/06/2053	V	99.997,21
RURAL HIPOTECARIO XII, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0323976011	RURAL.HIP.XII/VAR BTA 20530622 B	22/06/2053	V	99.996,74
RURAL HIPOTECARIO XII, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0323976029	RURAL.HIP.XII/VAR BTA 20530622 C	22/06/2053	V	99.996,24
RURALPYME 2 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0374352005	RURALPYME.2/VAR BTA 20300425 A1	25/04/2030	V	36.354,27
SANTANDER EMISORA 150, S.A. UNIPERSONAL	ES0307779001	SAN.EMISORA.150/VAR BOCAN 20121004	04/10/2012	V	4.088,36
TDA 15 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377979028	TDA.15-MIX/VAR BTA 20420627 A2 GTIA	27/06/2042	V	29.048,66
TDA 16 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377973039	TDA.16-MIX/VAR BTA 20350322 B2 GTIA	22/03/2035	V	83.095,00
TDA 20 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377981016	TDA.20-MIX/VAR BTA 20360426 B1 GTIA	26/04/2036	V	74.035,53
TDA 22 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377983012	TDA 22-MIXTO/VAR BTA 20460628 A1B	28/06/2046	V	67.755,00
TDA 23, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377984010	TDA 23/VAR BTA 20460922 B GTIA	22/09/2046	V	100.000,00
TDA 23, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377984028	TDA 23/VAR BTA 20460922 C GTIA	22/09/2046	V	100.000,00
TDA 9, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0308186024	TDA 9/VAR BTH 20171222 A3 GTIA	22/12/2017	V	20.336,95
TDA CAJAMAR 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377965019	TDA.CAJAMAR.2/VAR BTA 20410626 A2	26/06/2041	V	43.912,19
TDA CAM 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377993003	TDA.CAM.6/VAR BTA 20120728 A1 GTIA	28/07/2012	V	40.885,72
TDA CAM 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377994019	TDA.CAM.7/VAR BTA 20490226 A2 GTIA	26/02/2049	V	62.724,50
TDA CAM 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377955002	TDA.CAM.9/VAR BTA 20500428 A1 GTIA	28/04/2050	V	44.534,20
TDA CAM 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377955010	TDA.CAM.9/VAR BTA 20500428 A2 GTIA	28/04/2050	V	54.240,14
TDA CREDIFIMO 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377934007	TDA.CREDIFIMO.1/VAR BTA 20501125 A	25/11/2050	V	51.895,26
TDA IBERCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0338453006	TDA.IBERCAJA.4/VAR BTA 20440826 A1	26/08/2044	V	43.650,27
TDA IBERCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0338453014	TDA.IBERCAJA.4/VAR BTA 20440826 A2	26/08/2044	V	44.639,19
TDA IBERCAJA ICO-FTVPO, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0377936002	IBERCAJA.ICO/VAR BTH 20360526 AG	26/05/2036	V	94.745,94

CÉDULAS

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211014	BBVA/5,75 CEDHIP 20100927 GTIA	27/09/2010	5,750	104.429,97
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211030	BBVA/4,25 CEDHIP 20130129 GTIA	29/01/2013	4,250	105.376,31
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211048	BBVA/3,50 CEDHIP 20110315 GTIA	15/03/2011	3,500	102.685,59
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211055	BBVA/4,25 CEDHIP 20140715 GTIA	15/07/2014	4,250	105.942,05
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211071	BBVA/4,00 CEDHIP 20250225 GTIA	25/02/2025	4,000	94.824,15
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211097	BBVA/2,75 CEDHIP 20100607 GTIA	07/06/2010	2,750	100.959,68
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211105	BBVA/3,50 CEDHIP 20201007 GTIA	07/10/2020	3,500	96.432,55
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211113	BBVA/3,25 CEDHIP 20160124 GTIA	24/01/2016	3,250	99.174,76
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211121	BBVA/3,50 CEDHIP 20210124 GTIA	24/01/2021	3,500	93.935,72
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211139	BBVA/3,875 CEDHIP 20120531 GTIA	31/05/2012	3,875	103.999,66
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211154	BBVA/3,75 CEDHIP 20131004 GTIA	04/10/2013	3,750	103.312,72
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211162	BBVA/3,75 CEDTER 20111123 GTIA	23/11/2011	3,750	103.741,65
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211170	BBVA/4,25 CEDHIP 20170118 GTIA	18/01/2017	4,250	104.310,64
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211204	BBVA/4,50 CEDTER 20140530 GTIA	30/05/2014	4,500	53.333,27
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211261	BBVA/4,625 CEDTER 20120802 GTIA	02/08/2012	4,625	106.062,50
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211337	BBVA/3,00 CEDHIP 20141009 GTIA	09/10/2014	3,000	49.873,03
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0400230001	BCO.CTO.LOCAL/3,75 CEDTER 20100407	07/04/2010	3,750	101.180,58
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0400230068	BCO.CTO.LOCAL/3,75 CEDTER 20111020	20/10/2011	3,750	103.523,04
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860000	SAB/4,50 CEDHIP 20130429 GTIA	29/04/2013	4,500	105.557,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860018	SAB/3,75 CEDHIP 20110126 GTIA	26/01/2011	3,750	102.503,75
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860026	SAB/3,25 CEDHIP 20150615 GTIA	15/06/2015	3,250	98.576,07
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860034	SAB/3,50 CEDHIP 20160119 GTIA	19/01/2016	3,500	99.238,71
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860067	SAB/4,25 CEDHIP 20170124 GTIA	24/01/2017	4,250	102.516,32
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860109	SAB/5,00 CEDHIP 20100509 GTIA	09/05/2010	5,000	101.982,65
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440027	BTO/5,75 CEDHIP 20170327 GTIA	27/03/2017	5,750	113.736,36
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440035	BTO/4,00 CEDHIP 20100512 GTIA	12/05/2010	4,000	101.388,93
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440043	BTO/3,75 CEDHIP 20110223 GTIA	23/02/2011	3,750	102.790,72
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440050	BTO/4,25 CEDHIP 20140916 GTIA	16/09/2014	4,250	105.279,94
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440068	BTO/3,50 CEDHIP 20150127 GTIA	27/01/2015	3,500	101.008,96
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440076	BTO/2,75 CEDHIP 20120907 GTIA	07/09/2012	2,750	100.887,32
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440084	BTO/3,50 CEDHIP 20160118 GTIA	18/01/2016	3,500	100.658,89
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440092	BTO/4,25 CEDHIP 20130712 GTIA	12/07/2013	4,250	105.470,00
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440100	BTO/4,25 CEDHIP 20140221 GTIA	21/02/2014	4,250	105.616,18
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440159	BTO/3,625 CEDHIP 20130604 GTIA	04/06/2013	3,625	103.090,76
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440167	BTO/2,625 CEDHIP 20130228 GTIA	28/02/2013	2,625	49.944,14
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770001	PAS/3,75 CEDHIP 20150304 GTIA	04/03/2015	3,750	100.675,00
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770019	PAS/3,875 CEDHIP 20130920 GTIA	20/09/2013	3,875	102.862,04
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770050	PAS/6,00 CEDHIP 20100621 GTIA	21/06/2010	6,000	102.419,29
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770092	PAS/3,25 CEDHIP 20140317 GTIA	17/03/2014	3,250	99.728,41
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790009	POP/3,00 CEDHIP 20121018 GTIA	18/10/2012	3,000	100.950,79
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790017	POP/4,00 CEDHIP 20161018 GTIA	18/10/2016	4,000	102.159,95
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790058	POP/4,375 CEDHIP 20140616 GTIA	16/06/2014	4,375	52.735,77
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900020	SAN/4,00 CEDTER 20130708 GTIA	08/07/2013	4,000	104.680,00
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900038	SAN/4,00 CEDHIP 20100910 GTIA	10/09/2010	4,000	102.439,45
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900061	SAN/4,50 CEDHIP 20160729 GTIA	29/07/2016	4,500	105.824,52
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900079	SAN/3,25 CEDHIP 20120207 GTIA	07/02/2012	3,250	102.725,02
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900087	SAN/4,00 CEDHIP 20200407 GTIA	07/04/2020	4,000	99.793,75
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900095	SAN/2,50 CEDHIP 20110128 GTIA	28/01/2011	2,500	101.416,48
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900103	SAN/3,125 CEDHIP 20150928 GTIA	28/09/2015	3,125	99.144,27
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900111	SAN/3,50 CEDHIP 20140206 GTIA	06/02/2014	3,500	102.389,73
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900129	SAN/3,875 CEDHIP 20260206 GTIA	06/02/2026	3,875	92.423,96
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900137	SAN/3,75 CEDHIP 20110908 GTIA	08/09/2011	3,750	103.478,91
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900145	SAN/4,125 CEDHIP 20170109 GTIA	09/01/2017	4,125	103.271,18
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900152	SAN/4,25 CEDHIP 20130506 GTIA	06/05/2013	4,250	105.487,03
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900160	SAN/4,625 CEDHIP 20270504 GTIA	04/05/2027	4,625	102.155,64
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900178	SAN/4,50 CEDHIP 20121114 GTIA	14/11/2012	4,500	105.742,37
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900186	SAN/3,875 CEDHIP 20140527 GTIA	27/05/2014	3,875	103.951,40
BANKINTER, S.A.	ES0413679020	BKT/5,00 CEDHIP 20100514 GTIA	14/05/2010	5,000	50.968,55
BANKINTER, S.A.	ES0413679061	BKT/3,25 CEDHIP 20141113 GTIA	13/11/2014	3,250	99.459,45
BILBAO BIZKAIA KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA	ES0414100026	BBK/3,375 CEDHIP 20140929 GTIA	29/09/2014	3,375	100.294,75
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0414840274	CA.CATALUNYA/3,50 CEDHIP 20160307	07/03/2016	3,500	96.150,00
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0414840308	CA.CATALUNYA/4,875 CEDHIP 20170629	29/06/2017	4,875	102.597,28
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0414840381	CA.CATALUNYA/5,00 CEDHIP 20100519	19/05/2010	5,000	101.991,35
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0414826059	CAJASTUR/3,00 CEDHIP 20130628 GTIA	28/06/2013	3,000	49.767,05
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0414843146	CAIXAGALICIA/4,375 CEDHIP 20190123	23/01/2019	4,375	96.825,27
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0414843179	CAIXAGALICIA/5,25 CEDHIP 20100526	26/05/2010	5,250	51.126,73
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0414854036	CAJADUERO/VAR CEDHIP 20120629 GTIA	29/06/2012	V	999,56
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0414854044	CAJADUERO/VAR CEDHIP 20120929 GTIA	29/09/2012	V	999,07
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0414854051	CAJADUERO/6,50 CEDHIP 20100629 GTIA	29/06/2010	6,500	999,48
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0414854077	CAJADUERO/2,847 CEDHIP 20130628	28/06/2013	2,847	50.000,00
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0414977274	BANCAJA/5,00 CEDHIP 20100519 GTIA	19/05/2010	5,000	102.129,03
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0414400038	CAM/6,125 CEDHIP 20100625 GTIA	25/06/2010	6,125	102.993,78
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0414400079	CAM/3,375 CEDHIP 20141022 GTIA	22/10/2014	3,375	49.740,65
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0464730094	CAJASUR/VAR CEDHIP 20141124 GTIA	24/11/2014	V	100.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950552	CA.MADRID/5,50 CEDHIP 20100115 GTIA	15/01/2010	5,500	101.024,61
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950560	CA.MADRID/5,75 CEDHIP 20160629 GTIA	29/06/2016	5,750	111.340,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950586	CA.MADRID/5,25 CEDHIP 20120301 GTIA	01/03/2012	5,250	106.584,52
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950594	CA.MADRID/5,00 CEDHIP 20141030 GTIA	30/10/2014	5,000	107.930,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950610	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20110325 GTIA	25/03/2011	3,500	102.331,98
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950628	CA.MADRID/4,00 CEDHIP 20250203 GTIA	03/02/2025	4,000	92.723,03
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950636	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20151214 GTIA	14/12/2015	3,500	99.549,59
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950644	CA.MADRID/4,125 CEDHIP 20360324	24/03/2036	4,125	44.641,78
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950651	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20180525 GTIA	25/05/2018	4,250	50.213,15
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950669	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20160705 GTIA	05/07/2016	4,250	51.487,78
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950677	CA.MADRID/4,25 CEDTER 20140221 GTIA	21/02/2014	4,250	52.438,37

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950685	CA.MADRID/4,50 CEDHIP 20220426 GTIA	26/04/2022	4,500	49.628,19
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950693	CA.MADRID/5,00 CEDHIP 20190628 GTIA	28/06/2019	5,000	52.699,92
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950776	CA.MADRID/3,625 CEDHIP 20161005	05/10/2016	3,625	49.548,49
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950784	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20141113 GTIA	13/11/2014	3,500	49.951,31
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES0414954133	IBERCAJA/2,70 CEDHIP 20130614 GTIA	14/06/2013	2,700	49.607,95
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES0414954141	IBERCAJA/3,375 CEDHIP 20141127 GTIA	27/11/2014	3,375	49.959,03
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970139	LACAIXA/5,25 CEDHIP 20110405 GTIA	05/04/2011	5,250	104.816,64
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970162	LACAIXA/4,50 CEDHIP 20121121 GTIA	21/11/2012	4,500	105.827,49
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970170	LACAIXA/3,50 CEDHIP 20100301 GTIA	01/03/2010	3,500	100.836,18
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970188	LACAIXA/4,25 CEDHIP 20131031 GTIA	31/10/2013	4,250	105.077,02
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970196	LACAIXA/4,75 CEDHIP 20181031 GTIA	31/10/2018	4,750	105.414,97
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970204	LACAIXA/3,875 CEDHIP 20250217 GTIA	17/02/2025	3,875	91.489,81
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970212	LACAIXA/3,25 CEDHIP 20151005 GTIA	05/10/2015	3,250	98.706,53
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970238	LACAIXA/3,375 CEDHIP 20140630 GTIA	30/06/2014	3,375	50.587,56
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970246	LACAIXA/3,625 CEDHIP 20210118 GTIA	18/01/2021	3,625	46.965,28
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970253	LACAIXA/VAR CEDHIP 20160630 GTIA	30/06/2016	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970279	LACAIXA/VAR CEDHIP 20130820 GTIA	20/08/2013	V	48.212,50
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970287	LACAIXA/VAR CEDHIP 20130620 GTIA	20/06/2013	V	98.098,94
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970295	LACAIXA/4,25 CEDHIP 20170126 GTIA	26/01/2017	4,250	51.541,65
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970303	LACAIXA/4,50 CEDHIP 20220126 GTIA	26/01/2022	4,500	50.045,88
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970311	LACAIXA/3,75 CEDTER 20110913 GTIA	13/09/2011	3,750	51.631,95
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970337	LACAIXA/VAR CEDHIP 20160930 GTIA	30/09/2016	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970352	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170330 GTIA	30/03/2017	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970394	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170930 GTIA	30/09/2017	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970402	LACAIXA/4,625 CEDHIP 20190604 GTIA	04/06/2019	4,625	51.999,40
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970428	LACAIXA/VAR CEDHIP 20120330 GTIA	30/03/2012	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970444	LACAIXA/VAR CEDHIP 20110509 GTIA	09/05/2011	V	49.997,99
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970519	LACAIXA/3,75 CEDHIP 20140526 GTIA	26/05/2014	3,750	51.297,09
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0414601023	CAJAMAR/3,50 CEDHIP 20141023 GTIA	23/10/2014	3,500	99.410,84
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES0464872060	UNICAJA/3,125 CEDHIP 20141006 GTIA	06/10/2014	3,125	49.766,86
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0413495005	SAN.CONS.FIN/3,875 CEDHIP 20160323	23/03/2016	3,875	101.560,00

PAGARÉS

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES05118450D0	ABE/PAG 20101126	26/11/2010	C	98.741,54
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES05118450E8	ABE/PAG 20100827	27/08/2010	C	99.136,20
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845895	ABE/PAG 20100216	16/02/2010	C	99.722,96
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845911	ABE/PAG 20100223	23/02/2010	C	99.851,84
BANCA MARCH, S.A.	ES0513045072	BCA.MARCH/PAG 20100203	03/02/2010	C	997,53
BANCA MARCH, S.A.	ES05130450B8	BCA.MARCH/PAG 20100816	16/08/2010	C	991,88
BANCA MARCH, S.A.	ES05130450M5	BCA.MARCH/PAG 20100315	15/03/2010	C	998,33
BANCA MARCH, S.A.	ES05130450R4	BCA.MARCH/PAG 20100225	25/02/2010	C	997,83
BANCA MARCH, S.A.	ES05130450X2	BCA.MARCH/PAG 20100929	29/09/2010	C	986,54
BANCA MARCH, S.A.	ES05130451H3	BCA.MARCH/PAG 20101013	13/10/2010	C	986,57
BANCA MARCH, S.A.	ES05130451R2	BCA.MARCH/PAG 20101116	16/11/2010	C	986,20
BANCA MARCH, S.A.	ES05130451Z5	BCA.MARCH/PAG 20100115	15/01/2010	C	999,19
BANCA MARCH, S.A.	ES05130452C2	BCA.MARCH/PAG 20100901	01/09/2010	C	990,50
BANCA MARCH, S.A.	ES05130452L3	BCA.MARCH/PAG 20101214	14/12/2010	C	987,72
BANCA MARCH, S.A.	ES0513045304	BCA.MARCH/PAG 20100325	25/03/2010	C	996,48
BANCA MARCH, S.A.	ES0513045460	BCA.MARCH/PAG 20100507	07/05/2010	C	994,00
BANCA MARCH, S.A.	ES0513045940	BCA.MARCH/PAG 20100129	29/01/2010	C	996,76
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138619Z9	SAB/PAG 20100107	07/01/2010	C	999,87
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861D80	SAB/PAG 20100315	15/03/2010	C	998,34
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861E97	SAB/PAG 20100324	24/03/2010	C	998,11
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861F13	SAB/PAG 20100511	11/05/2010	C	994,24
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861H94	SAB/PAG 20100622	22/06/2010	C	994,96
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861I10	SAB/PAG 20100423	23/04/2010	C	994,98
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861K81	SAB/PAG 20100129	29/01/2010	C	997,05
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861L56	SAB/PAG 20100208	08/02/2010	C	998,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861M14	SAB/PAG 20100215	15/02/2010	C	998,34
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861M71	SAB/PAG 20100827	27/08/2010	C	990,88
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861M89	SAB/PAG 20100601	01/06/2010	C	994,86
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861M97	SAB/PAG 20100308	08/03/2010	C	997,85
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861N05	SAB/PAG 20100907	07/09/2010	C	988,48
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861N54	SAB/PAG 20100917	17/09/2010	C	990,16
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861N96	SAB/PAG 20100922	22/09/2010	C	988,36
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861O87	SAB/PAG 20100401	01/04/2010	C	994,63
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861P29	SAB/PAG 20100521	21/05/2010	C	995,55
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861P45	SAB/PAG 20100115	15/01/2010	C	999,33
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861P78	SAB/PAG 20100119	19/01/2010	C	999,03
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861P86	SAB/PAG 20101014	14/10/2010	C	987,93
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861R43	SAB/PAG 20101116	16/11/2010	C	987,43
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861R68	SAB/PAG 20101118	18/11/2010	C	987,51
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861S18	SAB/PAG 20100226	26/02/2010	C	998,12
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861S75	SAB/PAG 20101202	02/12/2010	C	989,39
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861S91	SAB/PAG 20100331	31/03/2010	C	997,16
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861T58	SAB/PAG 20101214	14/12/2010	C	987,86
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139802Y3	BVA/PAG 20100201	01/02/2010	C	997,53
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139803L8	BVA/PAG 20100115	15/01/2010	C	999,46
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139803M6	BVA/PAG 20101214	14/12/2010	C	986,95
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139803P9	BVA/PAG 20100325	25/03/2010	C	997,98
BANCO ESPIRITO SANTO SA SOCIEDAD ABIERTA	ES0513483042	ESPIRITO.SANTO/PAG 20100315	15/03/2010	C	998,38
BANCO ESPIRITO SANTO SA SOCIEDAD ABIERTA	ES0513483075	ESPIRITO.SANTO/PAG 20100602	02/06/2010	C	994,41
BANCO ESPIRITO SANTO SA SOCIEDAD ABIERTA	ES0513483141	ESPIRITO.SANTO/PAG 20100818	18/08/2010	C	988,64
BANCO ESPIRITO SANTO SA SOCIEDAD ABIERTA	ES0513483158	ESPIRITO.SANTO/PAG 20100504	04/05/2010	C	994,39
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135809H7	GUI/PAG 20100113	13/01/2010	C	998,38
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580G38	GUI/PAG 20100113	13/01/2010	C	99.962,29
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580G87	GUI/PAG 20100127	27/01/2010	C	99.763,57
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580H78	GUI/PAG 20100811	11/08/2010	C	99.162,95
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580H86	GUI/PAG 20100303	03/03/2010	C	99.778,25
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580I44	GUI/PAG 20100324	24/03/2010	C	99.795,98
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580K40	GUI/PAG 20100421	21/04/2010	C	99.452,71
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580L49	GUI/PAG 20100217	17/02/2010	C	99.781,08
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580M14	GUI/PAG 20100701	01/07/2010	C	99.282,07
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580M63	GUI/PAG 20100707	07/07/2010	C	99.292,16
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580M71	GUI/PAG 20100730	30/07/2010	C	99.249,83
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580N13	GUI/PAG 20101214	14/12/2010	C	98.723,72
BANCO PASTOR, S.A.	ES05137830A6	PAS/PAG 20100331	31/03/2010	C	998,08
BANCO PASTOR, S.A.	ES05137837R5	PAS/PAG 20100219	19/02/2010	C	999,02
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513783A96	PAS/PAG 20100125	25/01/2010	C	998,15
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513783B53	PAS/PAG 20100201	01/02/2010	C	997,73
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513783D10	PAS/PAG 20100315	15/03/2010	C	995,51
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513783E27	PAS/PAG 20100120	20/01/2010	C	998,02
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513783E50	PAS/PAG 20100422	22/04/2010	C	994,96
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804VH6	POP/PAG 20100104	04/01/2010	C	999,64
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804VM6	POP/PAG 20100625	25/06/2010	C	994,38
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804WW3	POP/PAG 20100115	15/01/2010	C	997,73
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804XK6	POP/PAG 20100122	22/01/2010	C	998,00
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804XV3	POP/PAG 20100730	30/07/2010	C	992,09
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804YK4	POP/PAG 20100820	20/08/2010	C	991,35
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804YV1	POP/PAG 20100903	03/09/2010	C	992,34
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804ZB0	POP/PAG 20100326	26/03/2010	C	998,07
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804ZF1	POP/PAG 20100611	11/06/2010	C	994,84
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804ZG9	POP/PAG 20100312	12/03/2010	C	998,39
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804ZH7	POP/PAG 20100917	17/09/2010	C	990,91
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804ZL9	POP/PAG 20100219	19/02/2010	C	998,24
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806192	POP/PAG 20100401	01/04/2010	C	997,81
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806275	POP/PAG 20100521	21/05/2010	C	994,87
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806283	POP/PAG 20101119	19/11/2010	C	987,09

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806390	POP/PAG 20101203	03/12/2010	C	987,67
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806416	POP/PAG 20100112	12/01/2010	C	999,64
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806473	POP/PAG 20101210	10/12/2010	C	987,86
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540013	BBE/PAG 20100616	16/06/2010	C	994,07
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135400M5	BBE/PAG 20100113	13/01/2010	C	999,29
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135400N3	BBE/PAG 20100514	14/05/2010	C	994,99
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135400R4	BBE/PAG 20100118	18/01/2010	C	999,55
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135400T0	BBE/PAG 20100128	28/01/2010	C	998,74
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135400U8	BBE/PAG 20100201	01/02/2010	C	998,03
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135400X2	BBE/PAG 20100215	15/02/2010	C	998,12
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135400Y0	BBE/PAG 20100305	05/03/2010	C	998,05
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135400Z7	BBE/PAG 20100310	10/03/2010	C	995,51
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401B6	BBE/PAG 20100315	15/03/2010	C	996,79
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401G5	BBE/PAG 20100330	30/03/2010	C	994,76
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401H3	BBE/PAG 20100528	28/05/2010	C	992,57
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401I1	BBE/PAG 20100826	26/08/2010	C	988,85
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401L5	BBE/PAG 20100419	19/04/2010	C	994,78
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401O9	BBE/PAG 20101028	28/10/2010	C	987,38
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401P6	BBE/PAG 20100209	09/02/2010	C	998,13
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401Q4	BBE/PAG 20100519	19/05/2010	C	994,89
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401R2	BBE/PAG 20100223	23/02/2010	C	998,12
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401S0	BBE/PAG 20100524	24/05/2010	C	994,93
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401V4	BBE/PAG 20100531	31/05/2010	C	994,85
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401W2	BBE/PAG 20100830	30/08/2010	C	991,32
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401X0	BBE/PAG 20100104	04/01/2010	C	999,58
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401Y8	BBE/PAG 20100120	20/01/2010	C	999,53
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135402A6	BBE/PAG 20100111	11/01/2010	C	999,55
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135402B4	BBE/PAG 20100615	15/06/2010	C	994,84
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135407B3	BBE/PAG 20100108	08/01/2010	C	998,34
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540999	BBE/PAG 20100505	05/05/2010	C	994,79
BANKINTER, S.A.	ES0513679LX0	BKT/PAG 20100120	20/01/2010	C	999,64
BANKINTER, S.A.	ES0513679MNX	BKT/PAG 20100420	20/04/2010	C	995,21
BANKINTER, S.A.	ES0513679MS8	BKT/PAG 20100319	19/03/2010	C	998,10
BANKINTER, S.A.	ES0513679N53	BKT/PAG 20100219	19/02/2010	C	997,97
BANKINTER, S.A.	ES0513679NT4	BKT/PAG 20100401	01/04/2010	C	998,05
BANKINTER, S.A.	ES0513679NW8	BKT/PAG 20100428	28/04/2010	C	996,73
BANKINTER, S.A.	ES0513679NZ1	BKT/PAG 20100507	07/05/2010	C	994,96
BANKINTER, S.A.	ES0513679OA2	BKT/PAG 20100520	20/05/2010	C	995,15
BANKINTER, S.A.	ES0513679OE4	BKT/PAG 20100618	18/06/2010	C	994,86
BANKINTER, S.A.	ES0513679OF1	BKT/PAG 20100111	11/01/2010	C	998,88
BANKINTER, S.A.	ES0513679OG9	BKT/PAG 20100610	10/06/2010	C	995,08
BANKINTER, S.A.	ES0513679OL9	BKT/PAG 20100730	30/07/2010	C	993,79
BANKINTER, S.A.	ES0513679OM7	BKT/PAG 20100201	01/02/2010	C	999,04
BANKINTER, S.A.	ES0513679ON5	BKT/PAG 20100820	20/08/2010	C	988,66
BANKINTER, S.A.	ES0513679OO3	BKT/PAG 20100301	01/03/2010	C	998,16
BANKINTER, S.A.	ES0513679OQ8	BKT/PAG 20100920	20/09/2010	C	991,28
BANKINTER, S.A.	ES0513679OT2	BKT/PAG 20100326	26/03/2010	C	998,25
BANKINTER, S.A.	ES0513679OV8	BKT/PAG 20100412	12/04/2010	C	995,07
BANKINTER, S.A.	ES0513679OW6	BKT/PAG 20101012	12/10/2010	C	989,74
BANKINTER, S.A.	ES0513679OY2	BKT/PAG 20101028	28/10/2010	C	988,14
BANKINTER, S.A.	ES0513679PA9	BKT/PAG 20100531	31/05/2010	C	994,96
BANKINTER, S.A.	ES0513679PB7	BKT/PAG 20101206	06/12/2010	C	988,32
BANKINTER, S.A.	ES0513679PC5	BKT/PAG 20101214	14/12/2010	C	988,09
BARCLAYS BANK, S.A.	ES0513985D57	BARCLAYS/PAG 20100604	04/06/2010	C	991,80
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424126	BBK.EMPTOS/PAG 20100202	02/02/2010	C	998,19
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134242F6	BBK.EMPTOS/PAG 20100126	26/01/2010	C	999,08
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134242G4	BBK.EMPTOS/PAG 20100311	11/03/2010	C	998,41
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134242K6	BBK.EMPTOS/PAG 20100326	26/03/2010	C	998,19
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134242R1	BBK.EMPTOS/PAG 20100108	08/01/2010	C	998,11
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134242Y7	BBK.EMPTOS/PAG 20100507	07/05/2010	C	995,66
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134243E7	BBK.EMPTOS/PAG 20101119	19/11/2010	C	988,89
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134243H0	BBK.EMPTOS/PAG 20100528	28/05/2010	C	995,11
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134243U3	BBK.EMPTOS/PAG 20100714	14/07/2010	C	991,44
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134243V1	BBK.EMPTOS/PAG 20100723	23/07/2010	C	992,71
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244F2	BBK.EMPTOS/PAG 20100210	10/02/2010	C	997,40
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244J4	BBK.EMPTOS/PAG 20100903	03/09/2010	C	988,80
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244M8	BBK.EMPTOS/PAG 20100316	16/03/2010	C	998,19
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244N6	BBK.EMPTOS/PAG 20100330	30/03/2010	C	996,04
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244O4	BBK.EMPTOS/PAG 20100930	30/09/2010	C	987,73
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244P1	BBK.EMPTOS/PAG 20100104	04/01/2010	C	998,88
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244Q9	BBK.EMPTOS/PAG 20100315	15/03/2010	C	996,89
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244R7	BBK.EMPTOS/PAG 20100419	19/04/2010	C	994,68
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244S5	BBK.EMPTOS/PAG 20101006	06/10/2010	C	987,72
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244T3	BBK.EMPTOS/PAG 20100115	15/01/2010	C	998,88
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244U1	BBK.EMPTOS/PAG 20101014	14/10/2010	C	987,78
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244V9	BBK.EMPTOS/PAG 20100129	29/01/2010	C	998,94
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244W7	BBK.EMPTOS/PAG 20101028	28/10/2010	C	988,13
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244X5	BBK.EMPTOS/PAG 20101110	10/11/2010	C	987,31
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244Z0	BBK.EMPTOS/PAG 20100910	10/09/2010	C	991,25
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134245A0	BBK.EMPTOS/PAG 20100615	15/06/2010	C	995,01
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134245B8	BBK.EMPTOS/PAG 20100618	18/06/2010	C	994,75
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134245C6	BBK.EMPTOS/PAG 20101220	20/12/2010	C	987,59
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687CH5	BBVAF/PAG 20100111	11/01/2010	C	999,39
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687CJ3	BBVAF/PAG 20100112	12/01/2010	C	999,73
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687CN3	BBVAF/PAG 20100126	26/01/2010	C	998,94

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687CZ7	BBVAF/PAG 20100129	29/01/2010	C	999,23
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687DE0	BBVAF/PAG 20100219	19/02/2010	C	999,29
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687D11	BBVAF/PAG 20100303	03/03/2010	C	998,33
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687D18	BBVAF/PAG 20100311	11/03/2010	C	998,38
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ED0	BBVAF/PAG 20100107	07/01/2010	C	999,54
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687FF2	BBVAF/PAG 20100315	15/03/2010	C	998,70
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687FR7	BBVAF/PAG 20100614	14/06/2010	C	995,24
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687FT3	BBVAF/PAG 20100215	15/02/2010	C	998,79
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687GE3	BBVAF/PAG 20100104	04/01/2010	C	999,83
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687GF0	BBVAF/PAG 20100127	27/01/2010	C	999,47
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687GK0	BBVAF/PAG 20100122	22/01/2010	C	999,52
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687GU9	BBVAF/PAG 20100201	01/02/2010	C	999,23
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687GV7	BBVAF/PAG 20100115	15/01/2010	C	999,50
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687HB7	BBVAF/PAG 20100125	25/01/2010	C	999,53
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687HC5	BBVAF/PAG 20100329	29/03/2010	C	998,65
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687HD3	BBVAF/PAG 20100325	25/03/2010	C	998,18
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687HF8	BBVAF/PAG 20100331	31/03/2010	C	998,29
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687HG6	BBVAF/PAG 20100503	03/05/2010	C	994,89
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687HK8	BBVAF/PAG 20100205	05/02/2010	C	999,11
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687HN2	BBVAF/PAG 20100118	18/01/2010	C	999,21
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687HO0	BBVAF/PAG 20100120	20/01/2010	C	999,54
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687HQ5	BBVAF/PAG 20100222	22/02/2010	C	998,81
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687HR3	BBVAF/PAG 20100225	25/02/2010	C	998,62
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687HT9	BBVAF/PAG 20100212	12/02/2010	C	998,41
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687HU7	BBVAF/PAG 20100108	08/01/2010	C	999,64
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687HV5	BBVAF/PAG 20100128	28/01/2010	C	999,59
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687HW3	BBVAF/PAG 20100211	11/02/2010	C	998,52
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687HX1	BBVAF/PAG 20100113	13/01/2010	C	999,34
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687HZ6	BBVAF/PAG 20100218	18/02/2010	C	998,76
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687IA7	BBVAF/PAG 20100105	05/01/2010	C	999,88
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ID1	BBVAF/PAG 20100301	01/03/2010	C	998,97
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687IH2	BBVAF/PAG 20100208	08/02/2010	C	999,24
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687II0	BBVAF/PAG 20100210	10/02/2010	C	999,17
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687IJ8	BBVAF/PAG 20100106	06/01/2010	C	999,77
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687IK6	BBVAF/PAG 20100224	24/02/2010	C	999,16
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687IL4	BBVAF/PAG 20100317	17/03/2010	C	998,46
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687IM2	BBVAF/PAG 20100316	16/03/2010	C	998,60
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687IN0	BBVAF/PAG 20100119	19/01/2010	C	999,64
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687IO8	BBVAF/PAG 20100318	18/03/2010	C	998,65
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687IP5	BBVAF/PAG 20100121	21/01/2010	C	999,72
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687IQ3	BBVAF/PAG 20100204	04/02/2010	C	999,38
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687IR1	BBVAF/PAG 20100322	22/03/2010	C	998,38
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687IS9	BBVAF/PAG 20100326	26/03/2010	C	998,44
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687IT7	BBVAF/PAG 20100304	04/03/2010	C	998,80
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687IV3	BBVAF/PAG 20100610	10/06/2010	C	996,45
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687IW1	BBVAF/PAG 20100226	26/02/2010	C	999,18
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687IX9	BBVAF/PAG 20100601	01/06/2010	C	996,78
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687IY7	BBVAF/PAG 20100406	06/04/2010	C	998,13
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840FZ4	CA.CATALUNYA/PAG 20100505	05/05/2010	C	49.729,80
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840GK4	CA.CATALUNYA/PAG 20100113	13/01/2010	C	49.929,58
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840GM0	CA.CATALUNYA/PAG 20100120	20/01/2010	C	49.904,70
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840GN8	CA.CATALUNYA/PAG 20100203	03/02/2010	C	49.870,62
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840GU3	CA.CATALUNYA/PAG 20100407	07/04/2010	C	49.716,55
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840GW9	CA.CATALUNYA/PAG 20101006	06/10/2010	C	49.315,33
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840GX7	CA.CATALUNYA/PAG 20100428	28/04/2010	C	49.732,06
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840GZ2	CA.CATALUNYA/PAG 20101117	17/11/2010	C	49.286,84
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840HA3	CA.CATALUNYA/PAG 20100526	26/05/2010	C	49.727,20
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840HG0	CA.CATALUNYA/PAG 20101209	09/12/2010	C	49.370,66
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840HH8	CA.CATALUNYA/PAG 20100331	31/03/2010	C	49.884,81
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840HK2	CA.CATALUNYA/PAG 20101222	22/12/2010	C	49.269,37
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249201	CA.GIRONA/PAG 20100421	21/04/2010	C	993,96
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES05132492R4	CA.GIRONA/PAG 20100127	27/01/2010	C	997,85
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES05132493A8	CA.GIRONA/PAG 20101208	08/12/2010	C	987,16
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES05148501A0	CA.MANRESA/PAG 20100917	17/09/2010	C	989,21
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES05148501B8	CA.MANRESA/PAG 20100706	06/07/2010	C	990,81
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0514973637	CA.SABADELL/PAG 20100120	20/01/2010	C	998,81
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0514973660	CA.SABADELL/PAG 20100528	28/05/2010	C	994,60
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0514973678	CA.SABADELL/PAG 20101203	03/12/2010	C	986,69
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149663U5	CA.PENEDES/PAG 20100603	03/06/2010	C	992,48
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149664A5	CA.PENEDES/PAG 20100330	30/03/2010	C	997,85
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149664B3	CA.PENEDES/PAG 20101116	16/11/2010	C	987,43
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846676	CA.LAIETANA/PAG 20101214	14/12/2010	C	987,72
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES05148262C5	CAJASTUR/PAG 20100305	05/03/2010	C	49.926,63
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES05148262T9	CAJASTUR/PAG 20100917	17/09/2010	C	49.496,83
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES05148262U7	CAJASTUR/PAG 20100331	31/03/2010	C	49.746,09
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES05148263C3	CAJASTUR/PAG 20101209	09/12/2010	C	49.408,93
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES05148263D1	CAJASTUR/PAG 20100910	10/09/2010	C	49.558,53
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES05148263E9	CAJASTUR/PAG 20100226	26/02/2010	C	49.937,18
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148434E6	CAIXAGALICIA/PAG 20100203	03/02/2010	C	998,04
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148434L1	CAIXAGALICIA/PAG 20100324	24/03/2010	C	996,25
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148434W8	CAIXAGALICIA/PAG 20100609	09/06/2010	C	995,11
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148434Z1	CAIXAGALICIA/PAG 20100714	14/07/2010	C	993,58
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148435A1	CAIXAGALICIA/PAG 20100127	27/01/2010	C	997,85
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148435G8	CAIXAGALICIA/PAG 20100414	14/04/2010	C	994,37
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148435H6	CAIXAGALICIA/PAG 20101006	06/10/2010	C	986,80

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148435I4	CAIXAGALICIA/PAG 20101117	17/11/2010	C	987,10
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148435J2	CAIXAGALICIA/PAG 20100526	26/05/2010	C	995,04
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148435K0	CAIXAGALICIA/PAG 20100721	21/07/2010	C	992,30
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148435L8	CAIXAGALICIA/PAG 20100616	16/06/2010	C	994,34
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148435M6	CAIXAGALICIA/PAG 20101201	01/12/2010	C	987,57
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148453H9	CAI/PAG 20100108	08/01/2010	C	99.806,98
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148454A2	CAI/PAG 20100510	10/05/2010	C	99.509,50
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155303Q7	CA.RIOJA/PAG 20100614	14/06/2010	C	99.477,10
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155303V7	CA.RIOJA/PAG 20100222	22/02/2010	C	99.830,22
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155304C5	CA.RIOJA/PAG 20100419	19/04/2010	C	99.483,15
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155304E1	CA.RIOJA/PAG 20100527	27/05/2010	C	99.497,31
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155304F8	CA.RIOJA/PAG 20101215	15/12/2010	C	98.619,70
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155304G6	CA.RIOJA/PAG 20101214	14/12/2010	C	98.791,61
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155304H4	CA.RIOJA/PAG 20100318	18/03/2010	C	99.811,34
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146005S6	CA.MURCIA/PAG 20100624	24/06/2010	C	993,83
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146005T4	CA.MURCIA/PAG 20101126	26/11/2010	C	987,45
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146005U2	CA.MURCIA/PAG 20100604	04/06/2010	C	995,06
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854E37	CAJADUERO/PAG 20100205	05/02/2010	C	999,10
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854F02	CAJADUERO/PAG 20100401	01/04/2010	C	994,51
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854F36	CAJADUERO/PAG 20100507	07/05/2010	C	993,72
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854F77	CAJADUERO/PAG 20100701	01/07/2010	C	993,82
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854F93	CAJADUERO/PAG 20100113	13/01/2010	C	999,36
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854G92	CAJADUERO/PAG 20100415	15/04/2010	C	997,05
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854H00	CAJADUERO/PAG 20100326	26/03/2010	C	997,36
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854H59	CAJADUERO/PAG 20101110	10/11/2010	C	986,94
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854H67	CAJADUERO/PAG 20101118	18/11/2010	C	987,08
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149756M4	CA.CANTABRIA/PAG 20100219	19/02/2010	C	9.986,22
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149756S1	CA.CANTABRIA/PAG 20100609	09/06/2010	C	9.952,01
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149756Z6	CA.CANTABRIA/PAG 20100315	15/03/2010	C	9.983,74
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149757B5	CA.CANTABRIA/PAG 20100419	19/04/2010	C	9.945,76
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149757C3	CA.CANTABRIA/PAG 20100531	31/05/2010	C	9.952,00
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES05149771D3	BANCAJA/PAG 20100125	25/01/2010	C	997,42
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES05149771J0	BANCAJA/PAG 20100216	16/02/2010	C	997,64
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES05149771L6	BANCAJA/PAG 20101210	10/12/2010	C	987,76
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153082L0	CA.VITAL/PAG 20100429	29/04/2010	C	49.736,41
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153082N6	CA.VITAL/PAG 20100506	06/05/2010	C	49.745,04
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153082W7	CA.VITAL/PAG 20100903	03/09/2010	C	49.617,00
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153082Y3	CA.VITAL/PAG 20101001	01/10/2010	C	49.358,62
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153082Z0	CA.VITAL/PAG 20100401	01/04/2010	C	49.728,25
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153083A1	CA.VITAL/PAG 20101007	07/10/2010	C	49.373,38
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153083H6	CA.VITAL/PAG 20100630	30/06/2010	C	49.711,15
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153083K0	CA.VITAL/PAG 20100503	03/05/2010	C	49.734,98
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153083M6	CA.VITAL/PAG 20101116	16/11/2010	C	49.376,38
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153083N4	CA.VITAL/PAG 20101118	18/11/2010	C	49.363,70
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153083O2	CA.VITAL/PAG 20100729	29/07/2010	C	49.613,98
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153083P9	CA.VITAL/PAG 20100603	03/06/2010	C	49.734,23
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153083R5	CA.VITAL/PAG 20101214	14/12/2010	C	49.386,10
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153083S3	CA.VITAL/PAG 20100318	18/03/2010	C	49.914,15
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144009R2	CAM/PAG 20100325	25/03/2010	C	997,99
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149615F6	CA.BURGOS/PAG 20100415	15/04/2010	C	9.942,36
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149616A5	CA.BURGOS/PAG 20101001	01/10/2010	C	9.871,50
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149616B3	CA.BURGOS/PAG 20100201	01/02/2010	C	9.976,78
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES05149100A0	CA.AVILA/PAG 20100217	17/02/2010	C	99.746,53
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES05149100E2	CA.AVILA/PAG 20101130	30/11/2010	C	98.716,68
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES05149100F9	CA.AVILA/PAG 20101202	02/12/2010	C	98.667,98
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES05149100H5	CA.AVILA/PAG 20101214	14/12/2010	C	98.693,78
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES05149107Z0	CA.AVILA/PAG 20100224	24/02/2010	C	99.878,81
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES05149108A5	CA.AVILA/PAG 20100428	28/04/2010	C	99.420,10
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES05149108B0	CA.AVILA/PAG 20100108	08/01/2010	C	99.772,82
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES05149109B5	CA.AVILA/PAG 20100201	01/02/2010	C	99.747,77
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES05149870R2	CA.EXTREM/PAG 20100331	31/03/2010	C	24.872,56
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES05149871R0	CA.EXTREM/PAG 20100315	15/03/2010	C	24.889,73
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES05149871S8	CA.EXTREM/PAG 20101112	12/11/2010	C	24.681,36
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES05149871U4	CA.EXTREM/PAG 20101214	14/12/2010	C	24.697,90
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA Y SAN SI	ES0515309567	KUTXA/PAG 20100930	30/09/2010	C	98.704,03
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA Y SAN SI	ES0515309575	KUTXA/PAG 20100401	01/04/2010	C	99.455,98
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA Y SAN SI	ES0515309583	KUTXA/PAG 20101013	13/10/2010	C	98.706,92
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA Y SAN SI	ES0515309609	KUTXA/PAG 20100224	24/02/2010	C	99.696,76
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA Y SAN SI	ES0515309617	KUTXA/PAG 20100422	22/04/2010	C	99.459,43
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA Y SAN SI	ES0515309658	KUTXA/PAG 20100426	26/04/2010	C	99.476,69
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES05149263B4	SA.NOSTRA/PAG 20100217	17/02/2010	C	9.974,12
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES05149264W8	SA.NOSTRA/PAG 20100201	01/02/2010	C	9.976,47
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES05149264Z1	SA.NOSTRA/PAG 20101116	16/11/2010	C	9.866,60
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES05149265B9	SA.NOSTRA/PAG 20101015	15/10/2010	C	9.992,75
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES05149265D5	SA.NOSTRA/PAG 20101202	02/12/2010	C	9.866,80
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950AC1	CA.MADRID/PAG 20100118	18/01/2010	C	997,70
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950AN8	CA.MADRID/PAG 20100812	12/08/2010	C	991,64
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950BH8	CA.MADRID/PAG 20100119	19/01/2010	C	999,31
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950BJ4	CA.MADRID/PAG 20100421	21/04/2010	C	995,06
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950B04	CA.MADRID/PAG 20101029	29/10/2010	C	987,52
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950BR7	CA.MADRID/PAG 20100210	10/02/2010	C	998,60
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950B5X	CA.MADRID/PAG 20100910	10/09/2010	C	991,36
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950CA1	CA.MADRID/PAG 20101217	17/12/2010	C	987,42
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950T41	CA.MADRID/PAG 20100111	11/01/2010	C	999,27
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950X60	CA.MADRID/PAG 20100507	07/05/2010	C	994,86

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950Z19	CA.MADRID/PAG 20100623	23/06/2010	C	994,79
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149659P3	CAN/PAG 20100105	05/01/2010	C	99.976,27
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149659S7	CAN/PAG 20100216	16/02/2010	C	99.898,44
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149659T5	CAN/PAG 20100323	23/03/2010	C	99.763,31
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149659V5	CAN/PAG 20100511	11/05/2010	C	99.506,56
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0514965A86	CAN/PAG 20100126	26/01/2010	C	99.791,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0514965A94	CAN/PAG 20100907	07/09/2010	C	99.080,32
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0514965B36	CAN/PAG 20100223	23/02/2010	C	99.863,49
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0514965B44	CAN/PAG 20100928	28/09/2010	C	98.771,99
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0514965B69	CAN/PAG 20100427	27/04/2010	C	99.452,20
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0514965B85	CAN/PAG 20101012	12/10/2010	C	98.774,35
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0514965C12	CAN/PAG 20101123	23/11/2010	C	98.714,32
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0514965C27	CAN/PAG 20100824	24/08/2010	C	99.084,80
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0514965C50	CAN/PAG 20101214	14/12/2010	C	98.690,66
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0514959388	CA.SEGOVIA/PAG 20100115	15/01/2010	C	49.898,94
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0514959677	CA.SEGOVIA/PAG 20100315	15/03/2010	C	49.759,31
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0514959701	CA.SEGOVIA/PAG 20101116	16/11/2010	C	49.334,96
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0514959743	CA.SEGOVIA/PAG 20101214	14/12/2010	C	49.330,79
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149540Q3	IBERCAJA/PAG 20100218	18/02/2010	C	998,96
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149540U5	IBERCAJA/PAG 20100401	01/04/2010	C	994,91
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149541A5	IBERCAJA/PAG 20100506	06/05/2010	C	995,85
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149541U1	IBERCAJA/PAG 20100930	30/09/2010	C	987,63
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149541M0	IBERCAJA/PAG 20100325	25/03/2010	C	998,17
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149541P3	IBERCAJA/PAG 20101014	14/10/2010	C	987,65
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149541T5	IBERCAJA/PAG 20100204	04/02/2010	C	998,28
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149541U3	IBERCAJA/PAG 20101111	11/11/2010	C	987,21
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149541V1	IBERCAJA/PAG 20101118	18/11/2010	C	987,58
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149541W9	IBERCAJA/PAG 20100520	20/05/2010	C	995,16
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149541Y5	IBERCAJA/PAG 20100617	17/06/2010	C	994,76
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149542I6	IBERCAJA/PAG 20101209	09/12/2010	C	988,29
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149549Z6	IBERCAJA/PAG 20100121	21/01/2010	C	998,88
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO CATOLIC	ES05151340Y7	CAJACIRCULO/PAG 20100831	31/08/2010	C	99.250,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO CATOLIC	ES05151341A5	CAJACIRCULO/PAG 20100202	02/02/2010	C	99.768,21
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970FD6	LACAIXA/PAG 20100921	21/09/2010	C	988,13
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970HC4	LACAIXA/PAG 20100107	07/01/2010	C	999,12
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970H1I	LACAIXA/PAG 20100112	12/01/2010	C	999,24
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970HK7	LACAIXA/PAG 20100119	19/01/2010	C	998,61
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970HM3	LACAIXA/PAG 20100126	26/01/2010	C	998,67
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970IH1	LACAIXA/PAG 20100209	09/02/2010	C	997,68
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970IS8	LACAIXA/PAG 20100104	04/01/2010	C	999,21
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970IU4	LACAIXA/PAG 20100316	16/03/2010	C	996,46
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970J44	LACAIXA/PAG 20101214	14/12/2010	C	988,43
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970JQ0	LACAIXA/PAG 20100111	11/01/2010	C	998,36
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970JS6	LACAIXA/PAG 20100323	23/03/2010	C	995,55
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970KA2	LACAIXA/PAG 20100427	27/04/2010	C	995,06
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970LO1	LACAIXA/PAG 20100629	29/06/2010	C	992,37
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970LU8	LACAIXA/PAG 20100907	07/09/2010	C	991,78
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970NV2	LACAIXA/PAG 20101110	10/11/2010	C	988,17
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES05150091J8	CAJACANARIAS/PAG 20100129	29/01/2010	C	998,02
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES05150091V3	CAJACANARIAS/PAG 20100326	26/03/2010	C	994,87
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES05150091Z4	CAJACANARIAS/PAG 20100226	26/02/2010	C	996,76
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES05150092B3	CAJACANARIAS/PAG 20100423	23/04/2010	C	994,55
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES05150092D9	CAJACANARIAS/PAG 20100409	09/04/2010	C	995,65
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES05150092H0	CAJACANARIAS/PAG 20100219	19/02/2010	C	998,16
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES05150092J6	CAJACANARIAS/PAG 20100115	15/01/2010	C	999,25
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES05150092L2	CAJACANARIAS/PAG 20100312	12/03/2010	C	998,07
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES05149839V9	LA.CAJA/PAG 20100423	23/04/2010	C	49.721,75
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0514983A27	LA.CAJA/PAG 20100507	07/05/2010	C	49.703,27
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0514983D57	LA.CAJA/PAG 20100201	01/02/2010	C	49.884,19
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0514983D99	LA.CAJA/PAG 20101103	03/11/2010	C	49.332,53
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0514983E56	LA.CAJA/PAG 20101130	30/11/2010	C	49.351,03
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306C48	CR.NAVARRA/PAG 20100217	17/02/2010	C	49.923,48
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306E53	CR.NAVARRA/PAG 20100324	24/03/2010	C	49.846,60
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306E79	CR.NAVARRA/PAG 20100106	06/01/2010	C	49.977,28
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306E95	CR.NAVARRA/PAG 20100203	03/02/2010	C	49.948,63
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306F11	CR.NAVARRA/PAG 20100317	17/03/2010	C	49.850,86
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306F29	CR.NAVARRA/PAG 20100428	28/04/2010	C	49.752,19
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306F45	CR.NAVARRA/PAG 20100414	14/04/2010	C	49.829,71
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306F60	CR.NAVARRA/PAG 20100421	21/04/2010	C	49.842,02
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306F78	CR.NAVARRA/PAG 20100104	04/01/2010	C	49.986,41
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306F86	CR.NAVARRA/PAG 20101215	15/12/2010	C	49.389,25
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306F94	CR.NAVARRA/PAG 20101208	08/12/2010	C	49.405,81
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309912F3	ELE.CAP/PAG 20100113	13/01/2010	C	49.916,58
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309912I7	ELE.CAP/PAG 20100120	20/01/2010	C	49.915,21
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309912L1	ELE.CAP/PAG 20100203	03/02/2010	C	49.913,10
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309912N7	ELE.CAP/PAG 20100210	10/02/2010	C	49.912,94
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309912V0	ELE.CAP/PAG 20100107	07/01/2010	C	49.909,23
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309912Z1	ELE.CAP/PAG 20100127	27/01/2010	C	49.956,90
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913B0	ELE.CAP/PAG 20100512	12/05/2010	C	49.759,59
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913C8	ELE.CAP/PAG 20100519	19/05/2010	C	49.758,04
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913D6	ELE.CAP/PAG 20100526	26/05/2010	C	49.758,23
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913E4	ELE.CAP/PAG 20100602	02/06/2010	C	49.750,69
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913J5	ELE.CAP/PAG 20100714	14/07/2010	C	49.673,80
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913J3	ELE.CAP/PAG 20100721	21/07/2010	C	49.623,75
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913K1	ELE.CAP/PAG 20100901	01/09/2010	C	49.482,74

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913L9	ELE.CAP/PAG 20100303	03/03/2010	C	49.895,94
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913N5	ELE.CAP/PAG 20100317	17/03/2010	C	49.900,09
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913O3	ELE.CAP/PAG 20100324	24/03/2010	C	49.902,96
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913P0	ELE.CAP/PAG 20100331	31/03/2010	C	49.747,74
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913Q8	ELE.CAP/PAG 20100414	14/04/2010	C	49.751,00
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913R6	ELE.CAP/PAG 20100421	21/04/2010	C	49.750,42
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913S4	ELE.CAP/PAG 20100428	28/04/2010	C	49.752,49
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913T2	ELE.CAP/PAG 20100505	05/05/2010	C	49.754,50
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913U0	ELE.CAP/PAG 20100217	17/02/2010	C	49.913,81
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913V8	ELE.CAP/PAG 20100224	24/02/2010	C	49.911,65
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913W6	ELE.CAP/PAG 20100616	16/06/2010	C	49.753,25
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913X4	ELE.CAP/PAG 20100623	23/06/2010	C	49.752,87
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870039	GAS/PAG 20100505	05/05/2010	C	995,11
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870088	GAS/PAG 20100215	15/02/2010	C	998,17
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870112	GAS/PAG 20100816	16/08/2010	C	991,78
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870161	GAS/PAG 20100125	25/01/2010	C	999,41
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870179	GAS/PAG 20100225	25/02/2010	C	998,18
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870195	GAS/PAG 20101105	05/11/2010	C	987,07
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870203	GAS/PAG 20101025	25/10/2010	C	987,77
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870211	GAS/PAG 20100517	17/05/2010	C	994,97
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870229	GAS/PAG 20101115	15/11/2010	C	987,10
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870237	GAS/PAG 20100525	25/05/2010	C	995,06
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870252	GAS/PAG 20100615	15/06/2010	C	994,71
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870260	GAS/PAG 20100115	15/01/2010	C	999,55
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870278	GAS/PAG 20100315	15/03/2010	C	998,15
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870286	GAS/PAG 20101203	03/12/2010	C	988,19
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870294	GAS/PAG 20100625	25/06/2010	C	993,91
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870302	GAS/PAG 20100325	25/03/2010	C	998,18
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0581380107	UNF/PAG 20100115	15/01/2010	C	997,56
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0581380J44	UNF/PAG 20100625	25/06/2010	C	992,79
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060252T4	HIDROCANTABRICO/PAG 20100114	14/01/2010	C	998,12
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060252Y4	HIDROCANTABRICO/PAG 20100215	15/02/2010	C	998,17
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253A2	HIDROCANTABRICO/PAG 20100226	26/02/2010	C	998,23
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253I5	HIDROCANTABRICO/PAG 20100129	29/01/2010	C	998,24
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253J3	HIDROCANTABRICO/PAG 20100430	30/04/2010	C	995,04
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253K1	HIDROCANTABRICO/PAG 20100730	30/07/2010	C	991,40
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253N5	HIDROCANTABRICO/PAG 20100531	31/05/2010	C	995,04
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253Q8	HIDROCANTABRICO/PAG 20100315	15/03/2010	C	998,20
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253R6	HIDROCANTABRICO/PAG 20100330	30/03/2010	C	995,07
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253S4	HIDROCANTABRICO/PAG 20101014	14/10/2010	C	987,59
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253T2	HIDROCANTABRICO/PAG 20100415	15/04/2010	C	994,80
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253U0	HIDROCANTABRICO/PAG 20101025	25/10/2010	C	987,09
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253V8	HIDROCANTABRICO/PAG 20101029	29/10/2010	C	987,70
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253W6	HIDROCANTABRICO/PAG 20100604	04/06/2010	C	994,98
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253X4	HIDROCANTABRICO/PAG 20100615	15/06/2010	C	994,95
IBERDROLA, S.A.	ES0544580E13	IBE/PAG 20100107	07/01/2010	C	999,66
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FK2	IBE/PAG 20100114	14/01/2010	C	997,97
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FL0	IBE/PAG 20100121	21/01/2010	C	998,55
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FM8	IBE/PAG 20100204	04/02/2010	C	999,06
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FR7	IBE/PAG 20100422	22/04/2010	C	995,03
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FS5	IBE/PAG 20100429	29/04/2010	C	995,23
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FT3	IBE/PAG 20100520	20/05/2010	C	995,36
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FU1	IBE/PAG 20100617	17/06/2010	C	992,90
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FW7	IBE/PAG 20100729	29/07/2010	C	991,89
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FY3	IBE/PAG 20100513	13/05/2010	C	995,66
IBERDROLA, S.A.	ES0544580GA1	IBE/PAG 20100826	26/08/2010	C	991,45
IBERDROLA, S.A.	ES0544580GE3	IBE/PAG 20101021	21/10/2010	C	988,33
IBERDROLA, S.A.	ES0544580GG8	IBE/PAG 20100527	27/05/2010	C	995,48
IBERDROLA, S.A.	ES0544580GH6	IBE/PAG 20100902	02/09/2010	C	991,78
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE CREDIT	ES05176175O9	LICO.LEASING/PAG 20101008	08/10/2010	C	98.613,49
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE CREDIT	ES05176175Q4	LICO.LEASING/PAG 20100218	18/02/2010	C	99.769,17
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANDO DE HU	ES05581971D3	CAJASOL/PAG 20100408	08/04/2010	C	994,82
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648723Y5	UNICAJA/PAG 20100120	20/01/2010	C	49.944,24
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648723Z2	UNICAJA/PAG 20100205	05/02/2010	C	49.886,95
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724A3	UNICAJA/PAG 20100219	19/02/2010	C	49.862,68
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724C9	UNICAJA/PAG 20100322	22/03/2010	C	49.859,86
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724D7	UNICAJA/PAG 20100420	20/04/2010	C	49.744,30
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724E5	UNICAJA/PAG 20100505	05/05/2010	C	49.768,83
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724J4	UNICAJA/PAG 20100621	21/06/2010	C	49.705,17
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724L0	UNICAJA/PAG 20100105	05/01/2010	C	49.959,39
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724P1	UNICAJA/PAG 20100906	06/09/2010	C	49.559,75
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724Q9	UNICAJA/PAG 20100920	20/09/2010	C	49.403,57
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724S5	UNICAJA/PAG 20101005	05/10/2010	C	49.392,63
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724V9	UNICAJA/PAG 20101119	19/11/2010	C	49.387,95
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724W7	UNICAJA/PAG 20101203	03/12/2010	C	49.439,28
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724X5	UNICAJA/PAG 20101220	20/12/2010	C	49.381,21
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0573093N66	REE/PAG 20100301	01/03/2010	C	998,36
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0573093N90	REE/PAG 20100315	15/03/2010	C	998,38
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0573093O24	REE/PAG 20100430	30/04/2010	C	996,80
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0573093O73	REE/PAG 20100201	01/02/2010	C	998,35
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0573093O81	REE/PAG 20100215	15/02/2010	C	998,36
REPSOL YPF, S.A.	ES0573516665	REP/PAG 20100118	18/01/2010	C	999,58
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AH7	SAN.CONS.FIN/PAG 20100129	29/01/2010	C	998,23
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AJ5	SAN.CONS.FIN/PAG 20100205	05/02/2010	C	997,50
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AJ3	SAN.CONS.FIN/PAG 20100219	19/02/2010	C	998,18

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495A03	SAN.CONS.FIN/PAG 20100326	26/03/2010	C	997,52
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AR6	SAN.CONS.FIN/PAG 20100430	30/04/2010	C	994,80
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AU0	SAN.CONS.FIN/PAG 20100507	07/05/2010	C	994,74
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BC6	SAN.CONS.FIN/PAG 20100618	18/06/2010	C	993,05
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BI3	SAN.CONS.FIN/PAG 20100716	16/07/2010	C	993,31
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BK9	SAN.CONS.FIN/PAG 20100108	08/01/2010	C	998,89
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BL7	SAN.CONS.FIN/PAG 20100806	06/08/2010	C	992,36
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BM5	SAN.CONS.FIN/PAG 20100115	15/01/2010	C	998,43
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BN3	SAN.CONS.FIN/PAG 20100813	13/08/2010	C	991,76
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BO1	SAN.CONS.FIN/PAG 20100820	20/08/2010	C	990,43
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BP8	SAN.CONS.FIN/PAG 20100122	22/01/2010	C	999,21
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BT0	SAN.CONS.FIN/PAG 20100917	17/09/2010	C	986,80
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BU8	SAN.CONS.FIN/PAG 20100226	26/02/2010	C	996,94
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BX2	SAN.CONS.FIN/PAG 20100312	12/03/2010	C	998,40
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BZ7	SAN.CONS.FIN/PAG 20101022	22/10/2010	C	987,43
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CD2	SAN.CONS.FIN/PAG 20101217	17/12/2010	C	987,48
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CG5	SAN.CONS.FIN/PAG 20100709	09/07/2010	C	993,08
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CP6	SAN.CONS.FIN/PAG 20100212	12/02/2010	C	998,34
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CS0	SAN.CONS.FIN/PAG 20100924	24/09/2010	C	988,22
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CU6	SAN.CONS.FIN/PAG 20100416	16/04/2010	C	995,77
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CV4	SAN.CONS.FIN/PAG 20101015	15/10/2010	C	987,74
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CW2	SAN.CONS.FIN/PAG 20100423	23/04/2010	C	994,77
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CZ5	SAN.CONS.FIN/PAG 20100514	14/05/2010	C	994,86
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495DA6	SAN.CONS.FIN/PAG 20101119	19/11/2010	C	988,24
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495DC2	SAN.CONS.FIN/PAG 20101126	26/11/2010	C	988,77
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495DD0	SAN.CONS.FIN/PAG 20100611	11/06/2010	C	995,48
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495DQ2	SAN.CONS.FIN/PAG 20100929	29/09/2010	C	987,20
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495DR0	SAN.CONS.FIN/PAG 20100409	09/04/2010	C	995,19
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495DS8	SAN.CONS.FIN/PAG 20101008	08/10/2010	C	989,37
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495DZ3	SAN.CONS.FIN/PAG 20101203	03/12/2010	C	986,94
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495ED8	SAN.CONS.FIN/PAG 20101210	10/12/2010	C	989,20
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495EE6	SAN.CONS.FIN/PAG 20100318	18/03/2010	C	998,19
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495EF3	SAN.CONS.FIN/PAG 20101223	23/12/2010	C	988,21
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495EH9	SAN.CONS.FIN/PAG 20100331	31/03/2010	C	998,17
TELEFONICA, S.A.	ES0578430HH1	TEF/PAG 20100115	15/01/2010	C	998,28
TELEFONICA, S.A.	ES0578430HJ9	TEF/PAG 20100215	15/02/2010	C	998,28
TELEFONICA, S.A.	ES0578430HJ7	TEF/PAG 20100226	26/02/2010	C	998,32
TELEFONICA, S.A.	ES0578430HK5	TEF/PAG 20100315	15/03/2010	C	998,27
TELEFONICA, S.A.	ES0578430HM1	TEF/PAG 20100330	30/03/2010	C	998,31

PARTICIPACIONES PREFERENTES

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCAJA EUROCAPITAL FINANCE, S.A.	KYG0727Q1073	BANCAJA.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	600,71
BANCAJA EUROCAPITAL FINANCE, S.A.	KYG0727Q1156	BANCAJA.FIN/VAR NACU AMTB PPR B		V	600,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0113860003	SAB/VAR NACU AMTB PPR		V	1.006,62
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0113440004	BTO/VAR NACU AMTB PPR 1		V	1.000,00
BANKINTER EMISIONES, S.A.	ES0113549002	BKT.EM/VAR NACU AMTB PPR I		V	44,78
BANKINTER EMISIONES, S.A.	ES0113549028	BKT.EM/VAR NACU AMTB PPR II		V	44,51
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224001	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	100,09
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224027	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR B		V	100,09
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224043	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR C		V	100,30
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224050	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR D		V	100,70
BBVA INTERNATIONAL LIMITED	KYG090001119	BBVA.INTL/VAR NACU AMTB PPR F		V	100,08
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL	KYG1280W1015	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.007,62
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL	KYG717151099	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.006,29
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL	KYG717151172	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.007,71
BVA PREFERENTES, S.A.	ES0115006001	BVA.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	32.594,21
CAIXA CATALUNYA PREFERENTS, S.A.	KYG175431025	CA.CAT.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.001,16
CAIXA CATALUNYA PREFERENTS, S.A.	KYG175431108	CA.CAT.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.001,25
CAIXA DE MANLLEU PREFERENTS, S.A.	ES0115328009	CA.MANLLEU.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	500,68
CAIXA GALICIA PREFERENTES, S.A., SOCIEDAD UNIPERSONAL	ES0112805009	CA.GALICIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	569,69
CAIXA GALICIA PREFERENTES, S.A., SOCIEDAD UNIPERSONAL	ES0112805025	CA.GALICIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR D		V	997,39
CAIXA GALICIA PREFERENTES, S.A., SOCIEDAD UNIPERSONAL	ES0112805041	CA.GALICIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR E		V	999,80
CAIXA LAIETANA SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFERENTS, S.A.	ES0113251005	LAIETANA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	35.031,92
CAIXA LAIETANA SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFERENTS, S.A.	ES0113251021	LAIETANA.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.005,08
CAIXA LAIETANA SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFERENTS, S.A.	KYG1754W1087	LAIETANA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.006,61
CAIXA MANRESA PREFERENTS, S.A.	ES0115211007	CA.MANRESA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	100,10
CAIXA ONTINYENT PREFERENTS, S.A.	ES0157083025	ONTINYENT.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	37.410,36
CAIXA PENEDES CAPITAL, S.A. SOCIEDAD UNIPERSONAL	ES0158672008	CA.PENEDES.CAP/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.003,93
CAIXA PENEDES CAPITAL, S.A. SOCIEDAD UNIPERSONAL	KYG1755N1079	CA.PENEDES.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.005,97
CAIXA PREFERENCE, S.A.	KYG175471039	CAIXA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.003,29
CAIXA PREFERENCE, S.A.	KYG175471112	CAIXA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.005,19
CAIXA TERRASSA, SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFERENTS	KYG175491094	TERRASSA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.001,11
CAIXANOVA EMISIONES, S.A.	ES0169075001	CAIXANOVA.EM/VAR NACU AMTB PPR A		V	60,12
CAIXANOVA EMISIONES, S.A.	ES0169075050	CAIXANOVA.EM/VAR NACU AMTB PPR D		V	100,81
CAIXASABADELL PREFERENTS, S.A.	ES0101339002	CAIXASAB.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.002,87
CAIXASABADELL PREFERENTS, S.A.	ES0101339028	CAIXASAB.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	37.351,41
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0114854005	CAJADUERO/VAR NACU AMTB PPR		V	100,05
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0114965009	CAN/VAR NACU AMTB PPR		V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0114959002	CA.SEGOVIA/VAR NACU AMTB PPR		V	1.001,84
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES0114954003	IBERCAJA/VAR NACU AMTB PPR 1*		V	22.302,04
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0114970009	LACAIXA/VAR NACU AMTB PPR I		V	1.005,43
CAJA DE AVILA PREFERENTES, S.A.	ES0122707005	CA.AVILA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.004,13
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE	ES0115474001	CA.ESPAÑA/VAR NACU AMTB PPR I		V	1.025,47
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SOCIEDAD DE PARTICIPACIONE	ES0115372007	CA.ESPAÑA.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.000,15
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0115009005	CAJACANARIAS/VAR NACU AMTB PPR		V	1.014,75
CAJA MADRID FINANCE PREFERRED	ES0115373005	CA.MAD.FIN.PREF/VAR NACU AMTB PPR I		V	95,21
CAJA MADRID FINANCE PREFERRED	ES0115373021	CA.MAD.FIN.PREF/VAR NACU AMTB PPR 2		V	102,29
CAJA RIOJA PREFERENTES, S.A.	ES0113698007	CA.RIOJA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	501,81
CAJA SAN FERNANDO PREFERENCE LIMITED	KYG1755U1195	CA.SAN.FER.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	300,56
CAJAGRANADA PREFERENTES S.A.U.	ES0158952004	CAGRANADA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	101,00
CAJAMURCIA FINANCE, S.A.	KYG175552051	CAJAMURCIA.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	502,22
CAJAMURCIA PREFERENTES, S.A. UNIPERSONAL	ES0114818000	CAJAMURCIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	505,94
CAJAMURCIA PREFERENTES, S.A. UNIPERSONAL	ES0114818059	CAJAMURCIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR E		V	503,02
CAJASUR SOCIEDAD DE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.I	KYG1755M1096	CAJASUR.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	601,52
CAM CAPITAL, S.A.	ES0114607007	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.008,68
CAM CAPITAL, S.A.	KYG1793R1020	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	600,82
CAM CAPITAL, S.A.	KYG1793R1103	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR B		V	600,68
CANTABRIA CAPITAL SOCIEDAD DE PARTICIPACIONES PREFERE	KYG1825G1082	CANTABRIA.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	603,11
CANTABRIA PREFERENTES, S.A. SOCIEDAD UNIPERSONAL	ES0182834004	CANTABRIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR I		V	1.001,05
CANTABRIA PREFERENTES, S.A. SOCIEDAD UNIPERSONAL	ES0182834020	CANTABRIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR 2		V	1.001,38
CANTABRIA PREFERENTES, S.A. SOCIEDAD UNIPERSONAL	ES0182834046	CANTABRIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR 3		V	1.007,37
EL MONTE CAPITAL, S.A.U.	KYG3014M1024	MONTE.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	500,57
EL MONTE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.	ES0128469006	EL.MONTE.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.001,19
EL MONTE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.	ES0128469022	EL.MONTE.PREF/VAR NACU AMTB PPR D		V	503,27
ENDESA CAPITAL FINANCE, LLC.	USU291871080	ELE.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR		V	22,33
GALLEGO PREFERENTES, S.A.U.	ES0170234001	GALLEGO.PREF/VAR NACU AMTB PPR 1		V	35.342,65
GUIPUZCOANO CAPITAL, S.A.	ES0143561001	GUI.CAP/VAR NACU AMTB PPR I		V	43,29
GUIPUZCOANO CAPITAL, S.A.	ES0143561043	GUI.CAP/VAR NACU AMTB PPR III		V	100,10
LA CAJA DE CANARIAS PREFERENTES, S.A.	ES0156844005	LA.CAJA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	501,35
LA CAJA DE CANARIAS PREFERENTES, S.A.	ES0156844054	LA.CAJA.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	504,35
PASTOR PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A. SOCIEDAD UNP	ES0168569004	PASTOR.PREF/VAR NACU AMTB PPR 1		V	100,00
POPULAR CAPITAL, S.A.	ES0170412003	POP.CAP./VAR NACU AMTB PPR D		V	100,62
REPSOL INTERNATIONAL CAPITAL LIMITED	KYG7513K1379	REP.INTL.CAP/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.003,82
REPSOL INTERNATIONAL CAPITAL LIMITED	KYG7513K1452	REP.INTL.CAP/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.004,40
SA NOSTRA SOCIEDAD DE PARTICIPACIONES PREFERENTES S.J	KYG7803W1069	SA.NOSTRA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.002,25
SABADELL INTERNATIONAL EQUITY, LTD	KYG773751063	SAB.INTL.EQ/VAR NACU AMTB PPR A		V	501,79
SANTANDER FINANCE CAPITAL, S.A. UNIPERSONAL	ES0175179060	SAN.FIN.CAP/VAR NACU AMTB PPR V		V	25,00
SANTANDER FINANCE CAPITAL, S.A. UNIPERSONAL	ES0175179078	SAN.FIN.CAP/VAR NACU AMTB PPR X		V	24,53
SOL MELIA FINANCE LIMITED	KYG8259W1033	SOL.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	97,29
SOS CORPORACION ALIMENTARIA PREFERENTES, S.A.	ES0130124003	SOS.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	22.038,65
TELEFONICA FINANCE USA, L.L.C.	USU87942AA33	TEF.FIN.USA/VAR NACU AMTB PPR		V	1.004,44
UNION FENOSA FINANCIAL SERVICES USA, LLC.	USU90716AA64	UNF.FINL.USA/VAR NACU AMTB PPR		V	21,48

RENTA VARIABLE

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
ABENGOA, S.A.	ES0105200416	ABG/AC 0,25			20,09
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0111845014	ABE/AC 3,00			15,38
ACCIONA, S.A.	ES0125220311	ANA/AC 1,00			88,97
ACERINOX, S.A.	ES0132105018	ACX/AC 0,25			14,11
ACS, ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS, S.A.	ES0167050915	ACS/AC 0,50			34,02
ADOLFO DOMINGUEZ, S.A.	ES0106000013	ADZ/AC 0,60			11,63
AFIRMA GRUPO INMOBILIARIO, S.A.	ES0110944016	AFR/AC 0,20			0,34
AGRICOLA DE FRUTOS SECOS, S.A.	ES0106325014	AGROFRUSE/AC 3,01			11,01
AHORRO FAMILIAR, S.A.	ES0107511018	AH.FAMILIAR/AC 6,00			25,93
ALFA S.A. DE C.V.	MXP000511016	AC. ALFA S/A			40,54
ALMIRALL, S.A.	ES0157097017	ALM/AC 0,12			9,08
AMCI HABITAT, S.A.	ES0109196313	AMCI/AC 3,00			5,20
AMERICA MOVIL, S.A. DE C.V.	MXP001691213	AC. AMERICA MOVIL. S/L			31,76
AMPER, S.A.	ES0109260531	AMP/AC 1,00			6,50
ANTENA 3 DE TELEVISION, S.A.	ES0109427734	A3TV/AC 0,75			6,51
ARCELOR MITTAL, S.A.	LU0323134006	ARCELORMITTAL/AC SVN			26,42
AVANZIT, S.A.	ES0172708317	AVZ/AC 0,50			0,78
AZKOYEN, S.A.	ES0112458312	AZK/AC 0,60			3,12
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0113211835	BBVA/AC 0,49			12,50
BANCO BRADESCO, S.A.	BRBBDACACNPR8	AC. BANCO BRADESCO -PREF.-			14,19
BANCO DE CHILE, S.A.	CLP0939W1081	AC. BANCO DE CHILE			33,43
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0113860A34	SAB/AC 0,125			4,47
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0113980F34	BVA/AC 0,25			5,74
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0113440038	BTO/AC 0,79			8,78
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0113580C31	GUI/AC 0,25			5,42
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0113580D30	GUI/ACPREF A 0,25			7,66
BANCO PASTOR, S.A.	ES0113770434	PAS/AC 0,33			5,10
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0113790531	POP/AC 0,10			5,96
BANCO RIO DE LA PLATA, S.A.	ARBRI0010194	AC. BCO SANTANDER RIO. S/B			1,38
BANCO SANTANDER PUERTO RICO	PR8028091034	AC. SANTANDER BANCORP			7,67
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0113900J37	SAN/AC 0,50			11,38
BANKINTER, S.A.	ES0113679I37	BKT/AC 0,30			7,51
BARON DE LEY, S.A.	ES0114297015	BDL/AC 0,60			34,60
BAYER AKTIENGESELLSCHAFT	DE000BAY0017	AC. BAYER			50,55
BBVA BANCO FRANCES, S.A.	ARP125991090	AC. BBVA BCO. FRANCES			1,35
BEFESA MEDIO AMBIENTE, S.A.	ES0114491014	BMA/AC 3,01			15,21
BODEGAS BILBAINAS, S.A.	ES0114930011	BODEGAS.BILB/AC 6,01			9,00
BODEGAS RIOJANAS, S.A.	ES0115002018	RIO/AC 0,75			7,38
BOLSAS Y MERCADOS ESPAÑOLES, SDAD HOLDING DE MDOS Y	ES0115056139	BME/AC 3,23			23,35
BRADESPAR	BRBRAPACNOR5	AC. BRADESPAR			13,91
BRADESPAR	BRBRAPACNPR2	AC. BRADESPAR -PREF.-			14,57
BRASKEM, S.A.	BRBRKMACNPA4	AC. BRASKEM -PREF.-			4,83
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0114400007	CAM/CUPARTVA 2,00			5,77
CAMPOFRIO FOOD GROUP, S.A.	ES0121501318	CFG/AC 1,00			6,96
CARTERA INDUSTRIAL REA, S.A.	ES0162292017	CART.IND.REA/AC 2,30			3,02
CEMENTOS MOLINS, S.A.	ES0117360117	CEMENTOS.MOLINS/AC 0,30			8,36
CEMENTOS PORTLAND VALDERRIVAS, S.A.	ES0117390411	CPL/AC 1,50			29,17
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNOR6	AC. ELETROBRAS			11,73
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNPB7	AC. ELETROBRAS. PREF. S/B			10,32
CIE AUTOMOTIVE, S.A.	ES0105630315	CIE/AC 0,25			3,78
CLINICA BAVIERA, S.A.	ES0119037010	CBVA/AC 0,10			8,22
CODERE, S.A.	ES0119256115	CDR/AC 0,20			5,98
COMPANHIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	BRMIGACNPR3	AC. CEMIG -PREF.-			11,56
COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	BRCPLEACNPB9	AC. COPEL -PREF.-			13,29
COMPANYIA D'AIGÜES DE SABADELL, S.A.	ES0107350011	AGUAS.SAB/AC B 12,02			59,73
COMPANÍA DE INVERSIONES MOBILIARIAS BARCINO, S.A.	ES0155972237	INV.MOB.BARCINO/AC 1,00			1,47
COMPANÍA ESPAÑOLA DE PETROLEOS, S.A.	ES0132580319	CEP/AC 1,00			23,50
COMPANÍA ESPAÑOLA DE VIVIENDAS EN ALQUILER, S.A.	ES0132955016	CEVASA/AC 6,00			156,90
COMPANÍA LEVANTINA DE EDIFICACION Y OBRAS PUBLICAS, S.A	ES0158300410	CLEO/AC 1,00			8,93
COMPANÍA LOGISTICA DE HIDROCARBUROS CLH, S.A.	ES0110480219	CLH/AC D 1,20			40,22
COMPANÍA VINICOLA DEL NORTE DE ESPAÑA, S.A.	ES0184140210	CUN/AC 0,24			14,48
CONSTRUCCIONES Y AUXILIAR DE FERROCARRILES, S.A	ES0121975017	CAF/AC 3,01			348,41
CORPORACION DERMOESTETICA, S.A.	ES0124204019	DERM/AC 0,10			3,29
CORPORACION FINANCIERA ALBA, S.A.	ES0117160111	ALB/AC 1,00			36,83
CORPORACION GEO, S.A. DE C.V.	MXP3142C1177	AC. GEO. S/B			1,88
CRITERIA CAIXACORP, S.A.	ES0140609019	CRI/AC 1,00			3,38
DINAMIA CAPITAL PRIVADO, S.A., SCR	ES0126501131	DIN/AC 3,00			10,69
DURO FELGUERA, S.A.	ES0162600417	MDF/AC 0,50			7,05
EBRO PULEVA, S.A.	ES0112501012	EVA/AC 0,60			13,39
ECCOWOOD INVEST, S.A.	ES0127232017	ECCOWOOD/AC 1,00			1,32
ELECNOR, S.A.	ES0129743318	ENO/AC 0,10			12,02
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD, S.A.	CLP3710M1090	AC. ENDESA CHILE			32,25
ENAGAS, S.A.	ES0130960018	ENG/AC 1,50			14,38
ENDESA, S.A.	ES0130670112	ELE/AC 1,20			22,43
ENERSIS, S.A.	CLP371861061	AC. ENERSIS			12,91
ERCROS, S.A.	ES0125140A14	ECR/AC 1,60			1,46
ESPAÑOLA DEL ZINC, S.A.	ES0132970213	ZNC/AC 1,00			1,32
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE AND SPACE COMPANY EAD	NL0000235190	AC. EADS			13,32
EXIDE TECHNOLOGIES, S.A.	ES0131600019	TUD/AC 3,01			7,47
FAES FARMA, S.A.	ES0134950F36	FAE/AC 0,10			3,89
FEDERICO PATERNINA, S.A.	ES0114989017	PAT/AC 6,01			7,35
FERGO AISA, S.A.	ES0106585013	AISA/AC 1,00			1,84
FERROVIAL, S.A.	ES0118900010	FER/AC 0,20			7,84
FERSA ENERGIAS RENOVABLES, S.A.	ES0136463017	FRS/AC 1,00			2,10
FINANZAS E INVERSIONES VALENCIANAS, S.A.	ES0138152113	F&I.VALENCIANAS/AC 1,00			96,30

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
FLUIDRA, S.A.	ES0137650018	FDR/AC 1,00			3,32
FOMENTO DE CONSTRUCCIONES Y CONTRATAS, S.A.	ES0122060314	FCC/AC 1,00			29,28
FUNESPAÑA, S.A.	ES0140441017	FUN/AC 0,30			5,86
GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA, S.A.	ES0143416115	GAM/AC 0,17			12,97
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0116870314	GAS/AC 1,00			14,22
GENERAL DE ALQUILER DE MAQUINARIA, S.A.	ES0141571119	GALQ/AC 1,00			5,88
GERDAU, S.A.	BRGGBRACNPR8	AC. GERDAU -PREF.-			10,93
GESTVISION TELECINCO, S.A.	ES0152503035	TL5/AC 0,50			8,13
GRIFOLS, S.A.	ES0171996012	GRF/AC 0,50			11,64
GRUPO CATALANA OCCIDENTE, S.A.	ES0116920333	GCO/AC 0,30			15,93
GRUPO ELEKTRA, S.A. DE C.V.	MX01EL000003	AC. GRUPO ELEKTRA			29,72
GRUPO EMPRESARIAL ENCE, S.A.	ES0130625512	ENC/AC 0,90			2,81
GRUPO EMPRESARIAL SAN JOSE, S.A.	ES0180918015	GSJ/AC 0,03			8,40
GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	MXP370711014	AC. BANORTE S/O			24,08
GRUPO IUSACELL, S.A. DE C.V.	MX01CE080006	AC. IUSACELL			2,48
GRUPO MODELO, S.A. DE C.V.	MXP4833F1044	AC. GRUPO MODELO. S/C			32,82
GRUPO TAVEX, S.A.	ES0108180219	TVX/AC 0,92			0,65
IBERDROLA RENOVABLES, S.A.	ES0147645016	IBR/AC 0,50			3,23
IBERDROLA, S.A.	ES0144580Y14	IBE/AC 0,75			6,43
IBERIA LINEAS AEREAS DE ESPAÑA, S.A.	ES0147200036	IBLA/AC 0,78			2,05
IBERPAPEL GESTION, S.A.	ES0147561015	IBG/AC 0,60			11,07
IMAGINARIUM, S.A.	ES0147791018	IMAGINARIUM/AC 0,03			4,06
INBESOS, S.A.	ES0150480111	NYE/AC 1,20			2,50
INDO INTERNACIONAL, S.A.	ES0148224118	IDO/AC 1,00			1,39
INDRA SISTEMAS, S.A.	ES0118594417	IDR/AC A 0,20			16,36
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL, S.A.	ES0148396015	ITX/AC 0,15			41,52
INDUSTRIAS DEL ACETATO DE CELULOSA, S.A.	ES0150160010	INACSA/AC 5,00			5,00
INMOBILIARIA COLONIAL, S.A.	ES0139140018	COL/AC 0,12			0,16
INMOBILIARIA DEL SUR, S.A.	ES0154653911	ISUR/AC 2,00			17,85
INMOLEVANTE, S.A.	ES0154949012	INMOLEVANTE/AC 3,00			15,01
INVERFIATC, S.A.	ES0143419317	INVERFIATC/AC 1,00			0,84
INVERPYME, S.C.R. DE REGIMEN COMUN, S.A.	ES0155151014	INVERPYME/AC 1,00			0,94
INYPESA INFORMES Y PROYECTOS, S.A.	ES0152768612	INY/AC 0,50			2,90
JAZZTEL, PLC.	GB0057933615	AC. JAZZTEL			0,29
LABORATORIOS FARMACEUTICOS ROVI, S.A.	ES0157261019	ROVI/AC 0,06			7,79
LIBERTAS 7, S.A.	ES0137998A12	LIBERTAS.7/AC 0,50			12,87
LINGOTES ESPECIALES, S.A.	ES0158480311	LGT/AC 1,00			3,69
LIWE ESPAÑOLA, S.A.	ES0158545030	LIWE ESPAÑOLA/AC 3,15			9,71
MAPFRE, S.A.	ES0124244E34	MAP/AC 0,10			3,04
MAPFRE, S.A.	ES0124244J39	MAP/ACNV 0,10			2,92
MECALUX, S.A.	ES0161928116	MLX/AC 1,00			11,95
METROVACESA, S.A.	ES0154220414	MVC/AC 1,50			20,24
MIQUEL Y COSTAS & MIQUEL, S.A.	ES0164180012	MCM/AC 2,00			15,07
MONTEBALITO, S.A.	ES0116494016	MTB/AC 1,00			4,53
NACIONAL FINANCIERA, S.N.C.	MX1BNA060006	NAFINSA/CERT NAFTRAC 2002			1,67
NATRA, S.A.	ES0165515117	NAT/AC 1,20			2,76
NATRACEUTICAL, S.A.	ES0165359011	NTC/AC 0,10			0,48
NET SERVIÇOS DE COMUNICAÇÃO, S.A.	BRNETCACNPR3	AC. NET SERVIÇOS DE COMUNICAÇÃO -PR			9,12
NH HOTELES, S.A.	ES0161560018	NHH/AC 2,00			3,90
NICOLAS CORREA, S.A.	ES0166300212	NEA/AC 0,80			2,31
OBRASCON HUARTE LAIN, S.A.	ES0142090317	OHL/AC 0,60			19,04
PAPELES Y CARTONES DE EUROPA, S.A.	ES0168561019	PAC/AC 2,00			3,69
PESCANOVA, S.A.	ES0169350016	PVA/AC 6,00			22,53
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNOR9	AC. PETROBRAS			16,52
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNPR6	AC. PETROBRAS -PREF.-			14,50
PRIM, S.A.	ES0170884417	PRM/AC 0,25			7,03
PROMOTORA DE INFORMACIONES, S.A.	ES0171743117	PRS/AC A 0,10			3,43
PROSEGUR, COMPAÑIA DE SEGURIDAD, S.A.	ES0175438235	PSG/AC 0,60			30,42
PULEVA BIOTECH, S.A.	ES0172233118	BIO/AC 0,24			1,20
REALIA BUSINESS, S.A.	ES0173908015	RLIA/AC 0,24			1,83
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0173093115	REE/AC 2,00			36,32
RENO DE MEDICI, S.P.A.	IT0001178299	AC. RENO DE MEDICI. S/A			0,25
RENTA 4 SERVICIOS DE INVERSION, S.A.	ES0173358039	R4/AC 0,40			5,22
RENTA CORPORACION REAL ESTATE, S.A.	ES0173365018	REN/AC 1,00			3,28
REPSOL YPF, S.A.	ES0173516115	REP/AC 1,00			18,59
REYAL URBIS, S.A.	ES0122761010	REY/AC 0,01			2,96
S.A. RONSA	ES0174300014	RONSA/AC 60,10			49,00
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES0182870214	SVY/AC 1,00			10,24
SARE HOLDING, S.A., DE C.V.	MX01SA030007	AC. SARE. S/B			2,62
SERVICE POINT SOLUTIONS, S.A.	ES0143421G11	SPS/AC 0,60			1,10
SNIACE, S.A.	ES0165380017	SNC/AC 0,10			1,45
SOCIEDAD ANONIMA DAMM	ES0125690513	DAMM/AC 0,20			5,87
SOCIEDAD ANONIMA HULLERA VASCO-LEONESA	ES0146940012	HULLERA.VAS-LE/AC 3,01			3,96
SOCIEDAD GENERAL DE AGUAS DE BARCELONA, S.A.	ES0141330C19	AGS/AC 1,00			19,24
SOL MELIA, S.A.	ES0176252718	SOL/AC 0,20			6,18
SOLARIA ENERGIA Y MEDIOAMBIENTE, S.A.	ES0165386014	SLR/AC 0,01			2,80
SOS CORPORACION ALIMENTARIA, S.A.	ES0110047919	SOS/AC 1,50			2,23
SOTOGRADE, S.A.	ES0138109014	STG/AC 0,60			5,48
TECNICAS REUNIDAS, S.A.	ES0178165017	TRE/AC 0,10			37,78
TECNOCOM, TELECOMUNICACIONES Y ENERGIA, S.A.	ES0147582B12	TEC/AC 0,50			2,99
TELEFONICA, S.A.	ES0178430E18	TEF/AC 1,00			19,25
TELEFONOS DE MEXICO, S.A.	MXP904131325	AC. TELMEX. S/L			11,80
TELMEX INTERNACIONAL, S.A.B. DE C.V.	MX01TE090014	AC. TELMEX INT S/L			10,39
TESTA INMUEBLES EN RENTA, S.A.	ES0170885018	TST/AC 6,00			9,15
TUBACEX, S.A.	ES0132945017	TUB/AC 0,45			2,92

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
TUBOS REUNIDOS, S.A.	ES0180850416	TRG/AC 0,10			2,13
TV AZTECA, S.A. DE C.V.	MXP740471117	AC. TV AZTECA			3,50
UNION EUROPEA DE INVERSIONES, S.A.	ES0181480114	U.EUROPEA.INV/AC 1,00			12,11
UNIPAPEL, S.A.	ES0182045312	UPL/AC 1,50			10,77
URALITA, S.A.	ES0182170615	URA/AC 0,72			4,09
URBAR INGENIEROS, S.A.	ES0182484214	URBAR.ING/AC 0,50			4,30
URBAS GUADAHERRA, S.A.	ES0182280018	URBAS/AC 0,25			0,16
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNOR3	AC. USIMINAS			18,72
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNPA6	AC. USIMINAS -PREF.-			19,40
VALE DO RIO DOCE,COMPANHIA	BRVALEACNOR0	AC. VALE DO RIO DOCE			18,39
VALE DO RIO DOCE,COMPANHIA	BRVALEACNPA3	AC. VALE DO RIO DOCE. PREF. 6%			16,09
VERTICE TRESCIENTOS SESENTA GRADOS, S.A.	ES0183304312	VER/AC 0,50			0,37
VIDRALA, S.A.	ES0183746314	VID/AC 1,02			18,14
VISCOFAN, S.A.	ES0184262212	VIS/AC 0,30			17,29
VOCENTO, S.A.	ES0114820113	VOC/AC 0,20			4,17
VOLCAN COMPAÑIA MINERA, S.A.A.	PEP648014202	AC. VOLCAN. PREF. S/B			8,27
VUELING AIRLINES, S.A.	ES0184591032	VLG/AC 1,00			12,65
ZARDOYA OTIS, S.A.	ES0184933812	ZOT/AC 0,10			14,06
ZELTIA, S.A.	ES0184940817	ZEL/AC 0,05			4,22
ZINKIA ENTERTAINMENT, S.A.	ES0184849018	ZNK/AC 0,10			2,28