

III. OTRAS DISPOSICIONES

MINISTERIO DE HACIENDA Y ADMINISTRACIONES PÚBLICAS

- 2843** *Orden HAP/377/2012, de 27 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 2011, a efectos de la declaración del impuesto sobre el patrimonio del año 2011 y de la declaración informativa anual acerca de valores, seguros y rentas.*

El Real Decreto-ley 13/2011, de 16 de septiembre, restablece el Impuesto sobre el Patrimonio, con carácter temporal durante los ejercicios 2011 y 2012, obligando a presentar declaración a los sujetos pasivos cuya cuota tributaria, determinada de acuerdo con las normas reguladoras del Impuesto y una vez aplicadas las deducciones o bonificaciones que procedieren, resulte a ingresar, o cuando, no dándose esta circunstancia, el valor de sus bienes o derechos, determinado de acuerdo con las normas reguladoras del impuesto, resulte superior a 2.000.000 de euros.

Con el fin de reflejar el adecuado cómputo de los mismos en la declaración del Impuesto sobre el Patrimonio, los artículos 13 y 15 de la Ley 19/1991, de 6 de junio, del Impuesto sobre el Patrimonio, establecen que el Ministerio de Economía y Hacienda (en la actualidad Ministerio de Hacienda y Administraciones Públicas) publicará anualmente una relación de los valores que se hayan negociado en mercados organizados, incluyendo los representativos de la cesión a terceros de capitales propios y los valores representativos de la participación en fondos propios de cualquier tipo de entidad, con su valor de negociación medio correspondiente al cuarto trimestre de cada año.

Por otra parte, 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 que las entidades que sean depositarias de valores mobiliarios tienen la obligación de suministrar a la Agencia Tributaria información 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, mediante la presentación de una declaración informativa a anual.

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 los referidos efectos, se hace 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 2011; 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 2011, anexas a esta Orden, a efectos de la declaración del Impuesto sobre el Patrimonio del ejercicio 2011 y para 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, 27 de febrero de 2012.—El Ministro de Hacienda y Administraciones Públicas, Cristóbal Montoro Romero.

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 2011, a los efectos previstos en los artículos 13 y 15 de la Ley 19/1991, de 6 de junio, del Impuesto sobre el Patrimonio y en el artículo 39 del Real Decreto 1.065/2007, de 27 de julio, por el que se aprueba el Reglamento General de la actuación 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 AUTÓNOMA DE LA REGION DE MURCIA	ES0000102188	CC.AA.MUR/4.75 BO 20121221 A	21/12/2012	4,750	100,000
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011595	ESTADO/8,70 OBE 20120228	28/02/2012	8,700	101,677
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011660	ESTADO/6,15 OBE SEGR 20130131	31/01/2013	6,150	102,271
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011702	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20130131	31/01/2013	C	93,360
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011843	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20120131	31/01/2012	C	99,800
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011850	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20130131	31/01/2013	C	94,604
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011868	ESTADO/6,00 OBE SEGR 20290131	31/01/2029	6,000	97,156
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011876	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20290131	31/01/2029	C	31,338
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011884	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20140131	31/01/2014	C	92,550
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011900	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20160131	31/01/2016	C	82,074
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011918	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170131	31/01/2017	C	78,178
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011926	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20180131	31/01/2018	C	72,300
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011942	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20200131	31/01/2020	C	65,538
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011959	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20210131	31/01/2021	C	59,347
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011975	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20230131	31/01/2023	C	55,250
ESTADO ESPAÑOL	ES0000011983	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20240131	31/01/2024	C	50,391
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012023	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20270131	31/01/2027	C	37,008
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012098	ESTADO/4,75 OBE SEGR 20140730	30/07/2014	4,750	101,097
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120C3	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20150131	31/01/2015	C	87,692
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120G4	ESTADO/3,15 OBE SEGR 20160131	31/01/2016	3,150	94,534
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120I0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20160131	31/01/2016	C	79,400
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120J8	ESTADO/3,80 OBE SEGR 20170131	31/01/2017	3,800	94,758
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120L4	ESTADO/3,90 BOEST SEGR 20121031	31/10/2012	3,900	99,789
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120M2	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20170131	31/01/2017	C	79,402
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120N0	ESTADO/4,90 OBE SEGR 20400730	30/07/2040	4,900	81,779
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120O8	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20400730	30/07/2040	C	17,689
ESTADO ESPAÑOL	ES00000120Y7	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20121031	31/10/2012	C	96,180
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121A5	ESTADO/4,10 OBE SEGR 20180730	30/07/2018	4,100	93,963
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121F4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20180730	30/07/2018	C	71,454
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121G2	ESTADO/4,80 OBESEGR 20240131	31/01/2024	4,800	90,290
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121H0	ESTADO/4,25 BOEST SEGR 20140131	31/01/2014	4,250	99,868
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121I8	ESTADO/2,75 BOEST SEGR 20120430	30/04/2012	2,750	99,556
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121J6	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20140131	31/01/2014	C	92,348
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121L2	ESTADO/4,60 OBESEGR 20190730	30/07/2019	4,600	96,473
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121O6	ESTADO/4,30 OBESEGR 20191031	31/10/2019	4,300	93,670
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121P3	ESTADO/3,30 BOEST SEGR 20141031	31/10/2014	3,300	97,378
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121Q1	ESTADO/VAR BOEST SEGR 20121029	29/10/2012	V	97,238
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121S7	ESTADO/4,70 OBESEGR 20410730	30/07/2041	4,700	79,400
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121T5	ESTADO/2,30 BOEST SEGR 20130430	30/04/2013	2,300	97,390
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121U3	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20141031	31/10/2014	C	89,830
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121W9	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20131031	31/10/2013	C	93,013
ESTADO ESPAÑOL	ES00000121Z2	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20161031	31/10/2016	C	80,555
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122A3	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20171031	31/10/2017	C	74,370
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122B1	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20181031	31/10/2018	C	66,150
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122D7	ESTADO/4,00 OBESEGR 20200430	30/04/2020	4,000	92,450
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122E5	ESTADO/4,65 OBESEGR 20250730	30/07/2025	4,650	87,850
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122F2	ESTADO/3,00 BOEST SEGR 20150430	30/04/2015	3,000	95,540
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122G0	ESTADO/VAR BOEST SEGR 20150317	17/03/2015	V	92,931
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122R7	ESTADO/2,50 BOESTSEGR 20131031	31/10/2013	2,500	96,986
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122T3	ESTADO/4,85 OBESEGR 20201031	31/10/2020	4,850	95,819
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122U1	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20250730	30/07/2025	C	43,183
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122V9	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20410730	30/07/2041	C	17,109
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122W7	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20410730	30/07/2041	C	17,971
ESTADO ESPAÑOL	ES00000122X5	ESTADO/3,25 BOESTSEGR 20160430	30/04/2016	3,250	94,061
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012304	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20140730	30/07/2014	C	89,075
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012353	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20140730	30/07/2014	C	89,772
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123B9	ESTADO/5,50 OBESEGR 20210430	30/04/2021	5,500	99,440
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123C7	ESTADO/5,90 OBESEGR 20260730	30/07/2026	5,900	96,950
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123D5	ESTADO/3,40 BOESTSEGR 20140430	30/04/2014	3,400	97,834
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123E3	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20160430	30/04/2016	C	83,218
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123J2	ESTADO/4,25 BOESTSEGR 20161031	31/10/2016	4,250	97,249
ESTADO ESPAÑOL	ES00000123K0	ESTADO/5,85 OBESEGR 20220131	31/01/2022	5,850	98,027
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012411	ESTADO/5,75 OBE 20320730	30/07/2032	5,750	93,346
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012601	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20150730	30/07/2015	C	85,491
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012619	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20160730	30/07/2016	C	79,224
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012627	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170730	30/07/2017	C	76,785
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012635	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20180730	30/07/2018	C	73,908
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012676	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20220730	30/07/2022	C	54,335
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012684	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20230730	30/07/2023	C	48,829
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012783	ESTADO/5,50 OBE SEGR 20170730	30/07/2017	5,500	102,223
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012791	ESTADO/5,00 OBE SEGR 20120730	30/07/2012	5,000	100,593
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012809	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20120730	30/07/2012	C	97,438
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012866	ESTADO/4,20 OBE SEGR 20130730	30/07/2013	4,200	100,020
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012916	ESTADO/4,40 OBE SEGR 20150131	31/01/2015	4,400	100,053

(*) ANCV: Agencia Nacional de Codificación de Valores

(**) V: Cupón Variable, C: Cupón Cero

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
ESTADO ESPAÑOL	ES0000012932	ESTADO/4,20 OBE SEGR 20370131	31/01/2037	4,200	74,360
FONDO DE REESTRUCTURACION ORDENADA BANCARI	ES0302761012	FROB/4,50 BO 20140203 GTIA	03/02/2014	4,500	100,328
FONDO DE REESTRUCTURACION ORDENADA BANCARI	ES0302761020	FROB/5,50 BO 20160712 GTIA	12/07/2016	5,500	101,263
FONDO DE REESTRUCTURACION ORDENADA BANCARI	ES0302761038	FROB/4,40 BO 20131021 GTIA	21/10/2013	4,400	98,670
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000950D1	GENCAT/AR BO 20130211	11/02/2013	V	97,118
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000950E9	GENCAT/4,95 OB 20200211	11/02/2020	4,950	78,500
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000950F6	GENCAT/5,75 BO 20150625	25/06/2015	5,750	104,023
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095770	GENCAT/5,20 OB 20120930	30/09/2012	5,200	98,750
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095838	GENCAT/4,35 OB 20140716	16/07/2014	4,350	88,572
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095895	GENCAT/4,30 OB 20161115	15/11/2016	4,300	85,626
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095903	GENCAT/4,12 BO 20130423	23/04/2013	4,125	96,397
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES0000095929	GENCAT/4,75 OB 20180604	04/06/2018	4,750	90,446
GOBIERNO VASCO	ES0000106429	GOB.VASCO/5,55 OB 20141126	26/11/2014	5,550	105,846
GOBIERNO VASCO	ES0000106437	GOB.VASCO/4,15 OB 20191028	28/10/2019	4,150	93,693
GOBIERNO VASCO	ES0000106494	GOB.VASCO/3,99 OB 20160128	28/01/2016	3,990	97,772
GOBIERNO VASCO	ES0000106510	GOB.VASCO/6,375 OB 20210420	20/04/2021	6,375	102,752

**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
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000950L4	GENCAT/5,375 BO 20130404	04/04/2013	5,375	99,120
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000950M2	GENCAT/4,25 BO 20120502	02/05/2012	4,250	99,102
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000950N0	GENCAT/4,75 BO 20130427	27/04/2013	4,750	97,873
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000950P5	GENCAT/4,75 BO 20121121	21/11/2012	4,750	99,105
GENERALIDAD DE CATALUÑA	ES00000950Q3	GENCAT/5,25 BO 20131121	21/11/2013	5,250	98,107
GENERALIDAD VALENCIANA	ES0000105686	GENVAL/4,25 BO 20120527	27/05/2012	4,250	982,84
GENERALIDAD VALENCIANA	ES0000105694	GENVAL/4,75 BO 20130527	27/05/2013	4,750	972,87
GENERALIDAD VALENCIANA	ES0000105702	GENVAL/5,00 BO 20121221	21/12/2012	5,000	994,40
GENERALIDAD VALENCIANA	ES0000105710	GENVAL/5,50 BO 20131220	20/12/2013	5,500	992,21

LETRAS DEL TESORO

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01201208	ESTADO/LT 20120120	20/01/2012	C	99,560
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01202172	ESTADO/LT 20120217	17/02/2012	C	99,300
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01203238	ESTADO/LT 20120323	23/03/2012	C	98,918
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01204202	ESTADO/LT 20120420	20/04/2012	C	98,583
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01205183	ESTADO/LT 20120518	18/05/2012	C	98,179
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01206223	ESTADO/LT 20120622	22/06/2012	C	97,961
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01207205	ESTADO/LT 20120720	20/07/2012	C	97,525
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01208245	ESTADO/LT 20120824	24/08/2012	C	97,191
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01209219	ESTADO/LT 20120921	21/09/2012	C	96,800
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01210191	ESTADO/LT 20121019	19/10/2012	C	96,437
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01211231	ESTADO/LT 20121123	23/11/2012	C	95,931
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01212148	ESTADO/LT 20121214	14/12/2012	C	96,023
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01302154	ESTADO/LT 20130215	15/02/2013	C	95,481
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01304192	ESTADO/LT 20130419	19/04/2013	C	94,259
ESTADO ESPAÑOL	ES0L01306213	ESTADO/LT 20130621	21/06/2013	C	95,278

OBLIGACIONES

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845161	ABE/VAR OB 20151019	19/10/2015	V	89.753,32
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845179	ABE/4,75 OB 20140211	11/02/2014	4,750	101.125,00
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845203	ABE/4,375 OB 20200330	30/03/2020	4,375	89.340,93
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845211	ABE/5,125 OB 20170612	12/06/2017	5,125	48.305,60
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845237	ABE/4,625 OB 20161014	14/10/2016	4,625	48.319,55
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR LEONESA, S.A.	ES0211843083	AUCALSA/4,00 OB 20140608	08/06/2014	4,000	485,70
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR LEONESA, S.A.	ES0211843091	AUCALSA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3,700	473,42
AUTOPISTA VASCO-ARAGONESA, C.E.S.A.	ES0211837077	AVASA/3,55 OB 20150615	15/06/2015	3,550	948,13
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839115	AUDASA/4,33 OB 20120516	16/05/2012	4,330	598,83
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839123	AUDASA/3,83 OB 20130626	26/06/2013	3,830	493,88
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839131	AUDASA/4,00 OB 20140608	08/06/2014	4,000	487,61
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839149	AUDASA/3,32 OB 20151212	12/12/2015	3,320	464,84
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839156	AUDASA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3,700	471,77
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839164	AUDASA/4,85 OB 20180327 GTIA	27/03/2018	4,850	491,78
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, C.E., S.A.	ES0211839172	AUDASA/6,00 OB 20210531 GTIA	31/05/2021	6,000	517,65
BANCA CIVICA, S.A.	ES0214965008	CAN/VAR OB SUBD 20160616	16/06/2016	V	93.390,00
BANCA CIVICA, S.A.	ES0214965024	CAN/VAR OBSUBD 20190630	30/06/2019	V	998,15
BANCA CIVICA, S.A.	ES0214979116	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20131001	30/03/2012	V	999,99
BANCA CIVICA, S.A.	ES0214979181	CA.GUADALAJ/VAR OBSUBD 20191230	30/12/2019	V	1.000,00
BANCA CIVICA, S.A.	ES0214981013	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD PERP	30/03/2012	V	601,73
BANCA CIVICA, S.A.	ES0214981039	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20321015	15/10/2012	V	299,61
BANCA CIVICA, S.A.	ES0214981054	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20200628	28/03/2012	V	299,96
BANCA CIVICA, S.A.	ES0217156092	EL.MONTE/VAR OB SUBD PERP	V	V	72.110,64
BANCA CIVICA, S.A.	ES0264870017	EL.MONTE/VAR OB SUBD PERP	01/06/2012	V	1.510,67
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211099	BBV/VAR OB SUBD 20191020	20/10/2019	V	79.387,62
BANCO CAM, S.A.	ES0214400014	CAM/VAR OB SUBD PERP	V	V	604,20
BANCO CAM, S.A.	ES0214400048	CAM/VAR OB SUBD PERP	V	V	599,99
BANCO CAM, S.A.	ES0214400055	CAM/VAR OB 20150815	15/08/2015	V	1.000,00
BANCO CAM, S.A.	ES0215395015	CAM/VAR OB SUBD PERP	V	V	608,71
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0214854012	CAJADUERO/VAR OBSUBD 20150630	30/06/2015	V	42.695,17
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0214854020	CAJADUERO/VAR OBSUBD 20181219	19/12/2018	V	44.866,09
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0214854038	CAJADUERO/VAR OBSUBD 20190928	28/09/2019	V	999,56
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0215474166	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20181229	29/12/2018	V	895,17
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0215474190	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20151207	07/12/2015	V	76.698,71
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0215474216	CA.ESPAÑA/VAR OB 20130517	17/05/2013	V	91.270,21
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0215474232	CA.ESPAÑA/7,50 OBSUBD 20180828	28/08/2018	7,500	1.036,69
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0215474240	CA.ESPAÑA/VAR OBSUBD 20200223	23/02/2020	V	980,46
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0215474257	CA.ESPAÑA/VAR OBSUBD 20200629	29/06/2020	V	930,08
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	ES0214825012	CA.ALBACETE/VAR OB SUBD PERP	V	V	607,99
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	ES0214825020	CA.ALBACETE/VAR OB SUBD PERP	V	V	605,93
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	ES0214842017	CA.CUENCA-C.R./VAR OB SUBD PERP	V	V	301,24
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	ES0214842025	CA.CUENCA-C.R./VAR OB PREF PERP	V	V	302,55
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	ES0215424120	CCM/VAR OB SUBD 20141220	20/12/2014	V	169.582,21
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	ES0215424138	CCM/VAR OB SUBD 20171214	14/12/2017	V	71.143,39
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	ES0215424153	CCM/VAR OB 20130728	28/07/2013	V	92.005,09
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	ES0215424161	CCM/VAR OB SUBD PERP	V	V	60.538,57
BANCO DE CASTILLA-LA MANCHA, S.A.	ES0215424179	CCM/VAR OB 20140528	28/05/2014	V	87.780,66
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860036	SAB/VAR OB SUBD 20160525	25/05/2016	V	69.569,07
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860051	SAB/6,25 OBSUBD 20200426	26/04/2020	6,250	42.248,71
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980024	BVA/VAR OB SUBD 20141215	15/12/2014	V	3.003,05
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214846042	CA.LAIETANA/VAR OB SUBD 20211010	10/10/2021	V	999,89
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214846059	CA.LAIETANA/VAR OB SUBD 20350315	15/03/2035	V	999,85
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214910012	CA.AVILA/VAR OBSUBD 20181029	29/10/2018	V	48.018,04
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214950059	CA.MADRID/6,25 OB SUBD 20120410	10/04/2012	6,250	98.855,22
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214950125	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20140715	15/07/2014	V	75.272,88
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214950141	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20180301	01/03/2018	V	64.952,25
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214950166	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20161017	17/10/2016	V	32.076,34
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214950224	CA.MADRID/VAR OBSUBD 20200607	07/06/2020	V	982,56
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214959068	CA.SEGOVIA/VAR OB SUBD 20160728	28/07/2016	V	47.906,42
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214959076	CA.SEGOVIA/VAR OB SUBD 20170620	20/06/2017	V	47.380,55
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214977037	BANCAJA/VAR OB SUBD PERP	V	V	601,01
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214977052	BANCAJA/VAR OB SUBD 20220704	04/07/2022	V	1.000,00
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214977078	BANCAJA/VAR OB SUBD 20181129	29/11/2018	V	59.968,20
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214977102	BANCAJA/VAR OB SUBD PERP	V	V	54.261,87
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214977169	BANCAJA/VAR OBSUBD 20190706	06/07/2019	V	998,34
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214983019	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP	V	V	301,05
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214983035	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP	V	V	302,33
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214983084	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20120801	01/08/2012	V	599,96
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214983092	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20131101	01/11/2013	V	499,97
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214983118	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20150412	12/04/2015	V	97.261,17
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0214983134	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP	V	V	30.000,00
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0215307028	CA.SAGUNTO/VAR OB SUBD PERP	V	V	601,01
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0215307036	CA.SAGUNTO/VAR OB SUBD 20120630	30/06/2012	V	601,01
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051008	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20130630	30/06/2013	V	595,40
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051016	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20131030	30/10/2013	V	599,21
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051024	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20160421	21/04/2016	V	47.715,95
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051032	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20161030	30/10/2016	V	46.236,19
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051057	BCO.GALLEGO/VAR OBSUBD 20191229	29/12/2019	V	99,88
BANCO GRUPO CAJATRES, S.A.	ES0214845002	CAI/VAR OB SUBD 20131222	22/12/2013	V	999,98
BANCO GRUPO CAJATRES, S.A.	ES0214845010	CAI/VAR OB SUBD 20140629	29/06/2014	V	86.000,00
BANCO GRUPO CAJATRES, S.A.	ES0214845028	CAI/VAR OB SUBD 20160525	25/05/2016	V	42.355,00
BANCO GRUPO CAJATRES, S.A.	ES0214845036	CAI/VAR OB SUBD 20190228	28/02/2019	V	1.000,01
BANCO GRUPO CAJATRES, S.A.	ES0214920029	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD PERP	V	V	609,99
BANCO GRUPO CAJATRES, S.A.	ES0214920045	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD PERP	V	V	601,03
BANCO GRUPO CAJATRES, S.A.	ES0214920052	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD PERP	V	V	601,01

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO GRUPO CAJATRES, S.A.	ES0214920060	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD 20211018	18/10/2021	V	600,00
BANCO GRUPO CAJATRES, S.A.	ES0214920078	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD 20230610	10/06/2023	V	599,99
BANCO GRUPO CAJATRES, S.A.	ES0214920086	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD 20250608	08/06/2025	V	600,00
BANCO GRUPO CAJATRES, S.A.	ES0214920094	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD 20220615	15/06/2022	V	600,00
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580014	GUI/4,50 OB SUBD 20121015	15/10/2012	4,500	499,97
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580022	GUI/4,20 OB SUBD 20141015	15/10/2014	4,200	491,35
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0214600035	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	303,13
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0214600043	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	306,09
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0214600050	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	300,53
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0214600084	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	300,52
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0214600092	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	300,52
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0214600175	CA.MURCIA/VAR OB SUBD 20141215	15/12/2014	V	299,98
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0214600191	CA.MURCIA/VAR OB SUBD 20230630	30/06/2023	V	500,04
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0214926018	SA.NOSTRA/VAR OB SUBD 20141230	30/12/2014	V	89.345,00
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0214926026	SA.NOSTRA/VAR OB SUBD 20150318	18/03/2015	V	1.000,61
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0214926034	SA.NOSTRA/VAR OBSUBD 20190630	30/06/2019	V	999,73
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0214966006	CA.PENEDES/VAR OB SUBD PERP		V	600,88
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0214966014	CA.PENEDES/VAR OB SUBD PERP		V	999,80
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0214966022	CA.PENEDES/VAR OB SUBD 20161222	22/12/2016	V	999,86
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0214966030	CA.PENEDES/VAR OBSUBD 20190629	29/06/2019	V	999,61
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0214982110	CA.GRANADA/VAR OB SUBD 20150630	30/06/2015	V	90.688,33
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0214982136	CA.GRANADA/VAR OBSUBD 20190316	16/03/2019	V	1.000,00
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790001	POP/VAR OBSUBD 20191222	22/12/2019	V	37.395,03
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790019	POP/8,00 OBSUBD 20210729	29/07/2021	8,000	987,66
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790027	POP/8,25 OBSUBD 20211019	19/10/2021	8,250	999,87
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0213900204	SAN/7,65 OB SUBD 20151215	15/12/2015	7,650	150.127,41
BANKIA, S.A.	ES0214950133	CA.MADRID/VAR OB 20120601	01/06/2012	V	97.867,13
BANKIA, S.A.	ES0214950158	CA.MADRID/VAR OB 20120209	09/02/2012	V	99.011,30
BANKIA, S.A.	ES0214977060	BANCAJA/3,94 OB 20150918	18/09/2015	3,940	1.000,00
BANKIA, S.A.	ES0214977086	BANCAJA/VAR OB 20120606	06/06/2012	V	97.485,00
BANKIA, S.A.	ES0214977094	BANCAJA/VAR OB 20160125	25/01/2016	V	76.129,43
BANKIA, S.A.	ES0214977128	BANCAJA/4,25 OB 20130526	26/05/2013	4,250	97.654,15
BANKIA, S.A.	ES0214977136	BANCAJA/VAR OB 20130923	23/09/2013	V	90.625,22
BANKIA, S.A.	ES0214977144	BANCAJA/4,375 OB 20170214	14/02/2017	4,375	83.012,16
BANKIA, S.A.	ES0214977151	BANCAJA/VAR OB 20140423	23/04/2014	V	43.215,25
BANKINTER, S.A.	ES0213679022	BKT/5,70 OB SUBD 20121218	18/12/2012	5,700	5.975,15
BANKINTER, S.A.	ES0213679121	BKT/VAR OB 20150316	16/03/2015	V	449,94
BANKINTER, S.A.	ES0213679147	BKT/VAR OB SUBD 20160623	23/06/2016	V	93.810,00
BANKINTER, S.A.	ES0213679162	BKT/VAR OB SUBD 20161219	19/12/2016	V	94.500,00
BANKINTER, S.A.	ES0213679196	BKT/6,375 OBSUBD 20190911	11/09/2019	6,375	48.398,56
BBK BANK CAJASUR, S.A.U.	ES0264730054	CAJASUR/VAR OB SUBD 20150311	11/03/2015	V	80.592,42
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0257080004	BPEF/VAR OB SUBD 20140630	30/06/2014	V	812,24
CABILDO INSULAR DE TENERIFE	ES0201330018	CBDO.TEN/VAR OB 20131202	02/12/2013	V	987,93
CAIXABANK, S.A.	ES0213249008	CA.GIRONA/VAR OB SUBD 20160921	21/09/2016	V	65.050,78
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	793,92
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970073	LACAIXA/VAR OBSUBD 20200330	30/03/2020	V	762,91
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COC	ES0215316029	RURALCAJA/VAR OB SUBD 20151122	22/11/2015	V	71.500,00
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0214840201	CA.CATALUNYA/VAR OB SUBD 20150519	19/05/2015	V	1.498,49
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0214840235	CA.CATALUNYA/VAR OB SUBD 20200220	20/02/2020	V	1.500,02
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0214840250	CA.CATALUNYA/VAR OB 20120706	06/07/2012	V	94.644,34
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0214840276	CA.CATALUNYA/VAR OB 20210321	21/03/2021	V	55.839,34
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0214840300	CA.CATALUNYA/VAR OB 20261013	13/10/2026	V	47.008,22
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0214840318	CA.CATALUNYA/VAR OB 20131018	18/10/2013	V	43.037,50
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0214840342	CA.CATALUNYA/VAR OBSUBD 20181218	18/12/2018	V	499,98
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0214850051	CA.MANRESA/VAR OBSUBD 20160505	05/05/2016	V	70.000,00
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0215346000	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20150527	27/05/2015	V	598,25
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0215346018	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20151027	27/10/2015	V	596,97
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0215346026	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20160427	27/04/2016	V	596,28
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0215346034	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20161027	27/10/2016	V	596,46
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0215346042	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20170127	27/01/2017	V	497,55
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0215346059	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20171127	27/11/2017	V	496,96
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0215346067	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20180727	27/07/2018	V	496,08
CORPORACION DE RESERVAS ESTRATEGICA DE PROD	ES0224261000	CORES/4,00 OB 20130715	15/07/2013	4,000	99.900,00
DEUTSCHE BANK, A.G.	DE0003933693	OB. DEUTSCHE BANK	10/11/2014	4,155	998,10
DEUTSCHE BANK, S.A.E.	ES0213320015	DT.BK.SAE/VAR OB SUBD 20131230	30/12/2013	V	96,17
DEUTSCHE BANK, S.A.E.	ES0213320023	DT.BK.SAE/VAR OB SUBD 20140331	31/03/2014	V	90,85
DEUTSCHE SIEDLUNGS UND LANDESRENTENBANK	ES0226393108	DSL BANK/5,26 OB 20130506	06/05/2013	5,260	634,97
EKSPORTFINANS A/S	ES0228528016	EKSPORTFINANS/8,40 OB 20161010	10/10/2016	8,400	592,03
ENAGAS, S.A.	ES0230960009	ENG/4,375 OB 20150706	06/07/2015	4,375	51.758,62
EROSKI, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429004	EROSKI/VAR OB SUBD PERP		V	25,04
EROSKI, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429038	EROSKI/VAR OB SUBD PERP		V	25,00
EUROP. PARA LA FINANC. MATERIAL FERROVIARIO	ES0233813163	EUROFIMA/11,00 OB 20141118	18/11/2014	11,000	7.621,40
FAGOR ELECTRODOMESTICOS, SOCIEDAD COOPERAT	ES0235972009	FAGOR/VAR OB SUBD 1º PERP		V	8,92
FAGOR ELECTRODOMESTICOS, SOCIEDAD COOPERAT	ES0235972017	FAGOR/VAR OB SUBD 2º PERP		V	10,01
FERIA MUESTRARIO INTERNACIONAL DE VALENCIA	ES0236395036	FERIA.VAL/6,04 OB 20270610	10/06/2027	6,040	96.633,44
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0214954010	IBERCAJA/VAR OB PREF PERP	23/01/2012	V	601,01
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0214954028	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP	23/01/2012	V	601,01
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0214954036	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP	23/01/2012	V	601,01
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0214954044	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP	23/01/2012	V	601,01
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0214954135	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20180420	20/04/2018	V	355,01
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0214954143	IBERCAJA/VAR OB 20120720	20/07/2012	V	96.793,40
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0214954150	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20190425	25/04/2019	V	325,63
IBERDROLA, S.A.	ES0244520138	HIDROLA/6,75 OB 20121215	15/12/2012	6,750	5,71

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
LIBERBANK, S.A.	ES0214826010	CAJASTUR/VAR OBSUBD 20190616	16/06/2019	V	99,92
LIBERBANK, S.A.	ES0214975007	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20121010	10/10/2012	V	1.000,00
LIBERBANK, S.A.	ES0214975015	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20140330	30/03/2014	V	1.000,02
LIBERBANK, S.A.	ES0214975023	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20151213	13/12/2015	V	44.025,87
LIBERBANK, S.A.	ES0214987028	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20171115	15/11/2017	V	500,00
LIBERBANK, S.A.	ES0214987044	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20191021	21/10/2019	V	500,00
LIBERBANK, S.A.	ES0214987069	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20200401	01/04/2020	V	500,00
LIBERBANK, S.A.	ES0214987077	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20210425	25/04/2021	V	7.970,72
MAPFRE, S.A.	ES0224244063	MAP/VAR OB SUBD 20370724	24/07/2037	V	31.182,46
NCG BANCO, S.A	ES0214843015	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD PERP		V	534,40
NCG BANCO, S.A	ES0214843023	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD PERP		V	600,41
NCG BANCO, S.A	ES0214843080	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20121001	01/10/2012	V	588,65
NCG BANCO, S.A	ES0214843098	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20131103	03/11/2013	V	574,73
NCG BANCO, S.A	ES0214843106	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20140401	01/04/2014	V	566,59
NCG BANCO, S.A	ES0214843114	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20150104	04/01/2015	V	532,73
NCG BANCO, S.A	ES0214843122	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20150704	04/07/2015	V	530,97
NCG BANCO, S.A	ES0214843130	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20160912	12/09/2016	V	36.010,67
NCG BANCO, S.A	ES0214958011	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20180108	08/01/2018	V	28,97
NCG BANCO, S.A	ES0214958029	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20180804	04/08/2018	V	591,43
NCG BANCO, S.A	ES0214958037	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20190126	26/01/2019	V	575,59
NCG BANCO, S.A	ES0214958045	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20201209	09/12/2020	V	72.503,01
NCG BANCO, S.A	ES0214958136	CAIXANOVA/VAR OBSUBD 20191216	16/12/2019	V	95,64
SOCIETE NATIONALE DES CHEMINS DE FER FRANCAIS	ES0277120020	SNCF/8,50 OB 20210823	23/08/2021	8,500	867,22
TELEFONICA, S.A.	ES0278430964	TEF/VAR OB 20150302	02/03/2015	V	96.701,71
UNNIM BANC, S.A.	ES0214841027	CA.MANLLEU/VAR OB SUBD 20130601	01/06/2013	V	499,92
UNNIM BANC, S.A.	ES0214973051	CA.SABADELL/VAR OB SUBD 20200128	28/01/2020	V	83.320,00
UNNIM BANC, S.A.	ES0214973069	CA.SABADELL/VAR OB SUBD 20170215	15/02/2017	V	35.326,70
UNNIM BANC, S.A.	ES0214973077	CA.SABADELL/VAR OBSUBD 20240610	10/06/2024	V	994,67
UNNIM BANC, S.A.	ES0214974018	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD PERP		V	601,01
UNNIM BANC, S.A.	ES0214974034	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20131230	30/12/2013	V	1.000,07
UNNIM BANC, S.A.	ES0214974042	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20190730	30/07/2019	V	999,82
UNNIM BANC, S.A.	ES0214974067	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20210809	09/08/2021	V	77.076,12
UNNIM BANC, S.A.	ES0214974117	CA.TERRASSA/VAR OBSUBD 20190929	29/09/2019	V	1.003,13
UNNIM BANC, S.A.	ES0314973027	CA.SABADELL/VAR OBSUBD PERP		V	599,25
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 II, F.T.A.	ES0312271002	AYT.BO.TESOR.II/VAR BTA 20130224 A	24/02/2013	V	20.744,25
AYT BONOS TESORERIA II, F.T.A.	ES0312271010	AYT.BO.TESOR.II/VAR BTA 20130224 B	24/02/2013	V	87.081,51
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298005	AYT.CCG/VAR BTA 20121214 I GTIA	14/12/2012	V	95.294,35
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298013	AYT.CCG/3,50 BTA 20160314 II GTIA	14/03/2016	3,500	88.005,70
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298021	AYT.CCG/3,75 BTA 20221214 III GTIA	14/12/2022	3,750	62.711,75
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298054	AYT.CCG/4,00 BTA 20210324 VI GTIA	24/03/2021	4,000	74.572,32
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298070	AYT.CCG/4,25 BTA 20180614 VIII GTIA	14/06/2018	4,250	84.348,85
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298088	AYT.CCG/3,75 BTA 20131025 IX GTIA	25/10/2013	3,750	95.804,52
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298104	AYT.CCG/4,00 BTA 20161220 XI GTIA	20/12/2016	4,000	87.667,19
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298112	AYT.CCG/4,00 BTA 20170321 XII GTIA	21/03/2017	4,000	85.732,45
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298120	AYT.CCG/4,75 BTA 20270525 XIII GTIA	25/05/2027	4,750	63.133,75
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298153	AYT.CCG/VAR BTA 20171023 XVI GTIA	23/10/2017	V	79.055,54
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL, F.T.A.	ES0312298237	AYT.CCG/4,25 BTA 20140729 XXIV GTIA	29/07/2014	4,250	95.577,08
AYT CEDULAS CAJAS III, F.T.A.	ES0361002001	AYT.CED.CA.III/5,25 BTA 20120628	28/06/2012	5,250	100.486,95
AYT CEDULAS CAJAS IV, F.T.A.	ES0312368006	AYT.CED.CA.IV/4,00 BTA 20130313	13/03/2013	4,000	97.670,61
AYT CEDULAS CAJAS IX, F.T.A.	ES0312358007	AYT.CED.CA.IX/3,75 BTA 20150331 A	31/03/2015	3,750	91.662,29
AYT CEDULAS CAJAS IX, F.T.A.	ES0312358015	AYT.CED.CA.IX/4,00 BTA 20200331 B	31/03/2020	4,000	74.000,00
AYT CEDULAS CAJAS V, F.T.A.	ES0370148019	AYT.CED.CA.V/4,75 BTA 20181204 B	04/12/2018	4,750	86.324,20
AYT CEDULAS CAJAS VI, F.T.A.	ES0312360003	AYT.CED.CA.VI/4,00 BTA 20140407 A	07/04/2014	4,000	95.342,07
AYT CEDULAS CAJAS VI, F.T.A.	ES0312360011	AYT.CED.CA.VI/4,00 BTA 20140407 B	07/04/2014	4,000	190.226,67
AYT CEDULAS CAJAS VIII, F.T.A.	ES0312362009	AYT.CED.CA.VIII/4,00 BTA 20141118 A	18/11/2014	4,000	94.444,94
AYT CEDULAS CAJAS VIII, F.T.A.	ES0312362017	AYT.CED.CA.VIII/4,25 BTA 20191118 B	18/11/2019	4,250	79.620,48
AYT CEDULAS CAJAS X, F.T.A.	ES0312342001	AYT.CED.CA.X/VAR BTA 20150630 A	30/06/2015	V	76.088,40
AYT CEDULAS CAJAS X, F.T.A.	ES0312342019	AYT.CED.CA.X/3,75 BTA 20250630 B	30/06/2025	3,750	58.502,77
AYT CEDULAS CAJAS XI, F.T.A.	ES0312213004	AYT.CED.CA.XI/VAR BTA 20121127 A	27/11/2012	V	96.230,31
AYT CELERIS HIPOTECARIO, F.T.A.	ES0384959005	AYT.CELERIS/VAR BTA 20460320 GTIA	20/03/2046	V	49.991,74
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A.	ES0312273081	COLAT.GLB.HIP./VAR BTA 20471116 A	16/11/2047	V	54.986,67
AYT DEUDA SUBORDINADA I, F.T.A.	ES0312284005	AYT.DEU.SUBD/VAR BTA 20161117 A	17/11/2016	V	72.473,99
AYT DEUDA SUBORDINADA I, F.T.A.	ES0312284013	AYT.DEU.SUBD/VAR BTA 20161117 B	17/11/2016	V	68.090,05
AYT DEUDA SUBORDINADA I, F.T.A.	ES0312284021	AYT.DEU.SUBD/VAR BTA 20161117 C	17/11/2016	V	20.044,10
AYT FONDO EOLICO, F.T.A.	ES0312376017	AYT.EOLICO/VAR BTA 20161229 E2 GTIA	29/12/2016	V	485,61
AYT GENOVA HIPOTECARIO II, F.T.H.	ES0370139000	AYT.GEN.H.II/VAR BTH 20341215 A	15/12/2034	V	27.019,13
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, F.T.H.	ES0312349014	AYT.GEN.H.VI/VAR BTH 20380115 A2	15/01/2038	V	50.459,32
AYT GENOVA HIPOTECARIO VII, F.T.H.	ES0312343017	AYT.GEN.H.VII/VAR BTH 20380915 A2	15/09/2038	V	26.634,58
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, F.T.H.	ES0312344015	AYT.GEN.H.VIII/VAR BTH 20390515 A2	15/05/2039	V	28.087,43
AYT GOYA HIPOTECARIO III, F.T.A.	ES0312274006	AYT.GOYA.HIP./VAR BTA 20521221 A	21/12/2052	V	30.977,42
AYT HIPOTECARIO IV, F.T.H.	ES0312370002	AYT.HIP.IV/VAR BTH 20330613 A GTIA	13/06/2033	V	17.591,93
AYT HIPOTECARIO IV, F.T.H.	ES0312370010	AYT.HIP.IV/VAR BTH 20330613 B GTIA	13/06/2033	V	76.092,62
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, F.T.A.	ES0312378005	AYT.HIP.MIX.III/VAR BTA 20380321 A	21/03/2038	V	20.643,74
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, F.T.A.	ES0312252028	AYT.HIP.MIX.V/VAR BTA 20410610 C	10/06/2041	V	80.786,35
AYT HIPOTECARIO MIXTO, F.T.A.	ES0312371000	AYT.HIP.MIX/VAR BTA 20330915 A GTIA	15/09/2033	V	16.635,19
AYT KUTXA HIPOTECARIO I, F.T.A.	ES0370153019	KUTXA.HIP.I/VAR BTA 20410422 B GTIA	22/04/2041	V	73.500,00
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, F.T.A.	ES0370154017	KUTXA.HIP.II/VAR BTA 20561015 B	15/10/2056	V	70.000,00
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, F.T.A.	ES0370154025	KUTXA.HIP.II/VAR BTA 20561015 C	15/10/2056	V	63.000,00
AYT PRESTAMOS CONSUMO III, F.T.A.	ES0312372008	AYT.PREST.C.III/VAR BTA 20210115 A	16/01/2021	V	3.279,21
AYT.1, F.T.H.	ES0338540000	AYT.1/VAR BTH 20281220 A GTIA	20/12/2028	V	7.769,69
AYT.11, F.T.H.	ES0338541016	AYT.11/VAR BTH 20351015 B GTIA	15/10/2035	V	76.150,62
BANCA CIVICA, S.A.	ES0314961121	CA.BURGOS/3,326 BO 20120618 GTIA	18/06/2012	3,326	49.333,93
BANCA CIVICA, S.A.	ES0314965106	CAN/3,26 BO 20150324 GTIA	24/03/2015	3,260	45.673,15
BANCA CIVICA, S.A.	ES0314981053	CAJACANARIAS/VAR BO 20120316 GTIA	16/03/2012	V	49.893,27
BANCA CIVICA, S.A.	ES0314981079	CAJACANARIAS/2,981 BO 20120702 GTIA	02/07/2012	2,981	49.155,88
BANCA CIVICA, S.A.	ES0358197012	CAJASOL/3,125 BO 20120427 GTIA	27/04/2012	3,125	49.893,69
BANCA CIVICA, S.A.	ES0358197038	CAJASOL/3,25 BO 20150225 GTIA	25/02/2015	3,250	47.077,50
BANCA CIVICA, S.A.	ES0358197053	CAJASOL/3,60 BO 20130628 GTIA	28/06/2013	3,600	49.550,00
BANCAJA 10, F.T.A.	ES0312872056	BANCAJA10/VAR BTA 20500522 D GTIA	22/05/2050	V	8.115,46
BANCAJA 11, F.T.A.	ES0312867056	BANCAJA.11/VAR BTA 20500427 D GTIA	27/04/2050	V	4.996,67
BANCAJA 7, F.T.A.	ES0312868049	BANCAJA.7/VAR BTA 20361125 D GTIA	25/11/2036	V	49.382,31
BANCAJA 8, F.T.A.	ES0312887005	BANCAJA.8/VAR BTA 20371025 A GTIA	25/10/2037	V	27.639,96
BANCAJA 8, F.T.A.	ES0312887013	BANCAJA.8/VAR BTA 20371025 B GTIA	25/10/2037	V	71.000,00
BANCAJA 9, F.T.A.	ES0312888029	BANCAJA.9/VAR BTA 20430925 B GTIA	25/09/2043	V	72.366,66
BANCAJA 9, F.T.A.	ES0312888045	BANCAJA.9/VAR BTA 20430925 D GTIA	25/09/2043	V	46.368,57
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211338	BBVA/VAR BOESTR 20140812 7	12/08/2014	V	40.513,23
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211361	BBVA/VAR BOESTR 20130812 11	12/08/2013	V	35.510,21
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211379	BBVA/VAR BOESTR 20130812 12	12/08/2013	V	36.105,89
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211395	BBVA/VAR BOESTR 20141104 15	04/11/2014	V	40.654,83
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211502	BBVA/4,35 BO 20130604	04/06/2013	4,350	99.943,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211510	BBVA/CUPCER BO 20141229	29/12/2014	C	87.511,00
BANCO CAM, S.A.	ES0314400070	CAM/VAR BO 20120515	15/05/2012	V	1.000,00
BANCO CAM, S.A.	ES0314400088	CAM/VAR BO 20120412	12/04/2012	V	100.098,46
BANCO CAM, S.A.	ES0314400096	CAM/3,125 BO 20120326 GTIA	26/03/2012	3,125	49.836,37
BANCO CAM, S.A.	ES0314400104	CAM/3,25 BO 20120427 GTIA	27/04/2012	3,250	49.714,55
BANCO CAM, S.A.	ES0314400120	CAM/2,875 BO 20120514 GTIA	14/05/2012	2,875	49.643,98
BANCO CAM, S.A.	ES0314400187	CAM/3,00 BO 20141112 GTIA	12/11/2014	3,000	47.286,70
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0313377014	BCO.COOP.ESP/3,125 BO 20120402 GTIA	02/04/2012	3,125	49.904,06
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0313377030	BCO.COOP.ESP/3,125 BO 20150122 GTIA	22/01/2015	3,125	47.400,57
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0313377048	BCO.COOP.ESP/4,878 BO 20140602 GTIA	02/06/2014	4,878	100.000,00
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0314854060	CAJADUERO/3,235 BO 20120619 GTIA	19/06/2012	3,235	49.776,04
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0314854136	CAJADUERO/3,782 BO 20150623 GTIA	23/06/2015	3,782	48.238,20
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0315474447	CA.ESPAÑA/VAR BO 20121122	22/11/2012	V	961,22
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0358673004	CA.ESP.DUERO/5,15 BO 20140607 GTIA	07/06/2014	5,150	50.090,43
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0358673038	CA.ESP.DUERO/5,90 BO 20161118 GTIA	18/11/2016	5,900	50.000,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860233	SAB/4,375 BO 20120522	22/05/2012	4,375	100.331,53
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860241	SAB/VAR BOSUBDCONV 20130721	21/07/2013	V	618,97
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860258	SAB/VAR BO 20120220	20/02/2012	V	49.730,41
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860274	SAB/VAR BO 20120802 CREC	02/08/2012	V	49.995,00

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860290	SAB/7,75 BOSUBDCONV 20131110	10/11/2013	7,750	3,08
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860316	SAB/4,25 BO 20130329	29/03/2013	4,250	999,82
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860324	SAB/5,44 BO 20141222 GTIA	22/12/2014	5,440	49.955,41
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0313980023	BVA/VAR BO 20120223	23/02/2012	V	48.525,45
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0313440143	BTO/4,08 BO 20160323	23/03/2016	4,080	93.415,64
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0314950660	CA.MADRID/3,875 BO 20131130 GTIA	30/11/2013	3,875	49.237,77
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0314950678	CA.MADRID/4,375 BO 20151130 GTIA	30/11/2015	4,375	49.006,59
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0314950694	CA.MADRID/5,25 BO 20160407 GTIA	07/04/2016	5,250	50.065,56
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0314950702	CA.MADRID/5,25 BO 20160407 GTIA	07/04/2016	5,250	49.426,19
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0314977358	BANCAJA/3,00 BO 20141027 GTIA	27/10/2014	3,000	47.682,91
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0314977366	BANCAJA/3,125 BO 20150121 GTIA	21/01/2015	3,125	47.308,45
BANCO GRUPO CAJATRES, S.A.	ES0315134009	CAJACIRCULO/VAR BO 20120308	08/03/2012	V	49.215,61
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0314600109	CA.MURCIA/VAR BO 20120326 GTIA	26/03/2012	V	50.000,00
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0314600117	CA.MURCIA/3,277 BO 20120320 GTIA	20/03/2012	3,277	49.989,67
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0314600158	CA.MURCIA/4,00 BO 20131120 GTIA	20/11/2013	4,000	49.651,14
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0314926025	SA.NOSTRA/3,00 BO 20141210 GTIA	10/12/2014	3,000	47.120,90
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0314966161	CA.PENEDES/VAR BO 20120717 GTIA	17/07/2012	V	48.919,36
BANCO PASTOR, S.A.	ES0313770077	PAS/3,00 BO 20120302 GTIA	02/03/2012	3,000	49.958,48
BANCO PASTOR, S.A.	ES0313770119	PAS/8,25 BOSUBDCONV 20140414	14/04/2014	8,250	87,85
BANCO PASTOR, S.A.	ES0313770143	PAS/5,80 BO 20161216 GTIA	16/12/2016	5,800	49.980,40
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0313790000	POP/3,00 BO 20120223 GTIA	23/02/2012	3,000	49.830,78
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0313790026	POP/3,00 BO 20120424 GTIA	24/04/2012	3,000	49.899,99
BANKIA, S.A.	ES0314846041	CA.LAIETANA/2,91 BO 20120605 GTIA	05/06/2012	2,910	49.625,00
BANKIA, S.A.	ES0314910045	CA.AVILA/VAR BO 20120430 GTIA	30/04/2012	V	49.681,29
BANKIA, S.A.	ES0314950454	CA.MADRID/3,125 BO 20120220 GTIA	20/02/2012	3,125	49.883,28
BANKIA, S.A.	ES0314950470	CA.MADRID/2,875 BO 20120416 GTIA	16/04/2012	2,875	49.854,42
BANKIA, S.A.	ES0314950686	CA.MADRID/VAR BO 20131130	30/11/2013	V	48.625,00
BANKIA, S.A.	ES0314959075	CA.SEGOVIA/2,50 BO 20121026 GTIA	26/10/2012	2,500	49.062,50
BANKIA, S.A.	ES0314977259	BANCAJA/VAR BO 20120124	24/01/2012	V	99.238,77
BANKIA, S.A.	ES0314977267	BANCAJA/VAR BO 20120321	21/03/2012	V	99.155,27
BANKIA, S.A.	ES0314977275	BANCAJA/3,00 BO 20120312 GTIA	12/03/2012	3,000	49.853,95
BANKIA, S.A.	ES0314977283	BANCAJA/VAR BO 20120318 GTIA	18/03/2012	V	49.524,36
BANKIA, S.A.	ES0314977325	BANCAJA/3,00 BO 20120511 GTIA	11/05/2012	3,000	49.792,96
BANKIA, S.A.	ES0314977341	BANCAJA/2,375 BO 20120918 GTIA	18/09/2012	2,375	49.224,60
BANKIA, S.A.	ES0315530040	CA.RIOJA/VAR BO 20120222	22/02/2012	V	99.000,00
BANKINTER 17, F.T.A.	ES0313582001	BKT.17/VAR BTA 20480307 A GTIA	07/10/2012	V	43.000,60
BANKINTER 2 PYME, F.T.A.	ES0313716013	BKT.2.PYME/VAR BTA 20430516 A2 GTIA	16/05/2043	V	27.468,04
BANKINTER 2 PYME, F.T.A.	ES0313716021	BKT.2.PYME/VAR BTA 20430516 B GTIA	16/05/2043	V	84.420,00
BANKINTER 2, F.T.H.	ES0313800031	BKT.2/VAR BTH 20340722 A4 GTIA	22/07/2034	V	18.088,88
BANKINTER 3, F.T.H.	ES0314019003	BKT.3/VAR BTH 20381016 A GTIA	16/10/2038	V	18.120,88
BANKINTER 8, F.T.A.	ES0313548002	BKT.8/VAR BTA 20401215 A GTIA	15/12/2040	V	27.275,10
BANKINTER 9, F.T.A.	ES0313814057	BKT.9/VAR BTA 20420716 A2T GTIA	16/07/2042	V	36.698,23
BANKINTER 9, F.T.A.	ES0313814073	BKT.9/VAR BTA 20420716 CT GTIA	16/07/2042	V	62.995,00
BANKINTER, S.A.	ES0313679443	BKT/VAR BO 20120621	21/06/2012	V	98.362,81
BANKINTER, S.A.	ES0313679450	BKT/3,00 BO 20120224 GTIA	24/02/2012	3,000	99.939,25
BANKINTER, S.A.	ES0313679476	BKT/VAR BO 20120615 II GTIA	15/06/2012	V	726.407,63
BANKINTER, S.A.	ES0313679484	BKT/VAR BO 20130115	15/01/2013	V	48.072,32
BANKINTER, S.A.	ES0313679575	BKT/7,00 BOSUBDCONV 20140511 SER I	11/05/2014	7,000	33,70
BANKINTER, S.A.	ES0313679583	BKT/7,00 BOSUBDCONV 20140511 SER II	11/05/2014	7,000	38,75
BANKINTER, S.A.	ES0313679617	BKT/VAR BOESTR 20140707	07/07/2014	V	45.716,30
BANKINTER, S.A.	ES0313679633	BKT/VAR BOESTR 20160803	03/08/2016	V	48.765,71
BANKINTER, S.A.	ES0313679658	BKT/VAR BOESTR 20160831	31/08/2016	V	49.234,65
BANKINTER, S.A.	ES0313679674	BKT/VAR BOESTR 20151016	16/10/2015	V	46.509,17
BANKINTER, S.A.	ES0313679708	BKT/VAR BOESTR 20161104	04/11/2016	V	50.000,00
BANKINTER, S.A.	ES0313679765	BKT/4,625 BO 20141229 GTIA	29/12/2014	4,625	50.000,00
BBK BANK CAJASUR, S.A.U.	ES0364730020	CAJASUR/3,17 BO 20120709 GTIA	09/07/2012	3,170	49.715,00
BBVA AUTOS 2, F.T.A.	ES0333761007	BBVA.AUTOS.2/VAR BTA 20191120 A	20/11/2019	V	13.856,32
BBVA CONSUMO 1, F.T.A.	ES0333763003	BBVA.CONSUMO.1/VAR BTA 20200120 A	20/01/2020	V	13.764,17
BBVA HIPOTECARIO 3, F.T.A.	ES0314227010	BBVA.HIP.3/VAR BTA 20381121 A2 GTIA	21/11/2038	V	19.484,41
BBVA LEASING 1, F.T.A.	ES0314209018	BBVA.LEASING.1/VAR BTA 20310526 A2	26/05/2031	V	15.789,65
BBVA RMBS 1, F.T.A.	ES0314147036	BBVA.RMBS1/VAR BTA 20500619 B GTIA	19/06/2050	V	48.510,00
BBVA RMBS 2, F.T.A.	ES0314148042	BBVA.RMBS2/VAR BTA 20500917 B GTIA	17/09/2050	V	50.739,45
BBVA SENIOR FINANCE, S.A.U.	ES0325467464	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121217	17/12/2012	C	35.553,97
BBVA SENIOR FINANCE, S.A.U.	ES0325467647	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20140623 68	23/06/2014	V	36.415,98
BBVA SENIOR FINANCE, S.A.U.	ES0325467662	BBVA.SR.FIN/4,75 BOESTR 20130506 70	06/05/2013	4,750	27.427,43
BBVA-3 FTPYME, F.T.A.	ES0310110020	BBVA3-PYME/VAR BTA 20280421 B GTIA	21/04/2028	V	20.028,48
BBVA-3 FTPYME, F.T.A.	ES0310110038	BBVA3-PYME/VAR BTA 20280421 C GTIA	21/04/2028	V	21.521,76
BBVA-4 PYME, F.T.A.	ES0370458038	BBVA4-PYME/VAR BTA 20380819 C GTIA	19/08/2038	V	4.826,20
BBVA-5 FTPYME, F.T.A.	ES0370459002	BBVA5-PYME/VAR BTA 20390315 A1 GTIA	15/03/2039	V	7.066,58
BBVA-6 FTPYME, F.T.A.	ES0370460000	BBVA6-PYME/VAR BTA 20460322 A1	22/03/2046	V	10.729,51
BBVA-8 FTPYME, F.T.A.	ES0370462014	BBVA8-PYME/VAR BTA 20411216 A2G	16/12/2041	V	52.396,32
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080144	BPEF/VAR BO 20120208	08/02/2012	V	99.081,41
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, F.T.A.	ES0357326026	PENEDES.PYMES.1/VAR BTA 20450928 C	28/09/2045	V	55.462,09
CAIXABANK, S.A.	ES0313249007	CA.GIRONA/VAR BO 20120322	22/03/2012	V	49.534,49
CAIXABANK, S.A.	ES0314970148	LACAIXA/VAR BO 20120803 CREC	03/08/2012	V	50.000,00
CAIXABANK, S.A.	ES0314970155	LACAIXA/VAR BO 20121029 CREC	29/10/2012	V	50.000,00
CAIXABANK, S.A.	ES0314970163	LACAIXA/3,75 BO 20131105	05/11/2013	3,750	49.079,59
CAIXABANK, S.A.	ES0314970197	LACAIXA/VAR BO 20130309 CREC	09/03/2013	V	49.993,73
CAIXABANK, S.A.	ES0314970205	LACAIXA/VAR BO 20130621 CREC	21/06/2013	V	100.000,00
CAIXABANK, S.A.	ES0340609009	CABK/4,125 BO 20141120	20/11/2014	4,125	48.580,25
CAIXABANK, S.A.	ES0340609017	CABK/7,00 BOSUBDCONV 20131210	10/12/2013	7,000	73,52
CAIXABANK, S.A.	ES0340609025	CABK/VAR BOESTR 20140721	21/07/2014	V	42.159,13
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0313249049	CA.GIRONA/3,09 BO 20120619 GTIA	19/06/2012	3,090	49.667,50
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0313249056	CA.GIRONA/2,512 BO 20121026 GTIA	26/10/2012	2,512	49.112,50
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0314970098	LACAIXA/3,375 BO 20120203 GTIA	03/02/2012	3,375	50.025,60

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJAMAR CAJA RURAL, S. COOP. DE CREDITO	ES0314601024	CAJAMAR/3,125 BO 20120330 GTIA	30/03/2012	3,125	49.806,33
CAJAMAR CAJA RURAL, S. COOP. DE CREDITO	ES0314601057	CAJAMAR/VAR BO 20130503 GTIA	03/05/2013	V	48.687,33
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0314840168	CA.CATALUNYA/3,00 BO 20120305 GTIA	05/03/2012	3,000	49.900,45
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0314840176	CA.CATALUNYA/3,00 BO 20120507 GTIA	07/05/2012	3,000	49.838,39
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0314840184	CA.CATALUNYA/3,00 BO 20141029 GTIA	29/10/2014	3,000	47.467,01
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0314840234	CA.CATALUNYA/VAR BO 20150623 GTIA	23/06/2015	V	48.795,00
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0316932005	CATALUNYA.BANC/VAR BOESTR 20141201	01/12/2014	V	49.989,07
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0318538073	CATALUNYA.CAIXA/VAR BO 20120228	28/02/2012	V	49.652,50
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0318538156	CATALUNYA.CAIXA/VAR BOESTR 20140929	29/09/2014	V	49.939,80
CEAMI GUARANTEED BONDS I, F.T.A.	ES0315944001	CEAMI.BONDS.I/3,125 BTA 20120622	22/06/2012	3,125	49.617,55
CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 3, F.T.A.	ES0318822006	CED.POP.3/4,25 BTA 20170426 GTIA	26/04/2017	4,250	94.271,12
CEDULAS TDA 2, F.T.A.	ES0317019000	CED.TDA.2/4,50 BTA 20131126 GTIA	26/11/2013	4,500	97.490,15
CEDULAS TDA 3, F.T.A.	ES0317043000	CED.TDA.3/4,38 BTA 20160303 1 GTIA	03/03/2016	4,375	89.919,31
CEDULAS TDA 5, F.T.A.	ES0317045005	CED.TDA.5/4,13 BTA 20191129 A GTIA	29/11/2019	4,125	78.290,89
CEDULAS TDA 6, F.T.A.	ES0317046003	CED.TDA.6/3,88 BTA 20250523 GTIA	23/05/2025	3,875	64.156,00
CEDULAS TDA 7, F.T.A.	ES0317047001	CED.TDA.7/3,50 BTA 20170620 GTIA	20/06/2017	3,500	83.312,00
EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 3, F.T.A.	ES0330876014	TDA.CAM.3/VAR BTA 20400128 A2 GTIA	28/01/2040	V	33.882,87
ENAGAS, S.A.	ES0330960008	ENG/3,25 BO 20120706	06/07/2012	3,250	50.338,06
ENDESA CAPITAL, S.A.U.	ES0330991003	ELE.CAP/VAR BO 20120705	05/07/2012	V	49.651,84
FINANCAT 1, F.T.A.	ES0338002027	FINANCAT.1/VAR BTA 20231015 C GTIA	15/10/2023	V	21.044,76
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMI	ES03382041012	SAN.EMPR.1/VAR BTA 20381104 A2 GTIA	04/11/2038	V	7.054,99
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMI	ES0338058011	SAN.EMPR.2/VAR BTA 20500623 A2 GTIA	23/06/2050	V	13.302,66
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMI	ES0337710018	SAN.EMPR.3/VAR BTA 20491016 A2 GTIA	16/10/2049	V	21.412,01
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIP	ES03382042002	SAN.HIP.2/VAR BTA 20490118 A GTIA	18/01/2049	V	41.266,63
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 11	ES0338340005	UCI.11/VAR BTA 20410915 A GTIA	15/09/2041	V	20.626,24
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 14	ES0338341011	UCI.14/VAR BTA 20430620 B GTIA	20/06/2043	V	22.584,27
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 14	ES0338341029	UCI.14/VAR BTA 20430620 C GTIA	20/06/2043	V	30.000,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 16	ES0338186028	UCI.16/VAR BTA 20490616 B GTIA	16/06/2049	V	15.352,81
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 16	ES0338186044	UCI.16/VAR BTA 20490616 D GTIA	16/06/2049	V	10.569,61
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 9	ES0338222005	UCI.9/VAR BTA 20350619 A GTIA	19/06/2035	V	13.985,39
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 9	ES0338222013	UCI.9/VAR BTA 20350619 B GTIA	19/06/2035	V	33.323,65
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, HIPOTEBANSA 1	ES0338447008	HIPOTEBANSA.11/VAR BTA 20350215 A	15/02/2035	V	20.526,82
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA EL	ES0378641007	FADE/4,80 BTA 20140317 1 GTIA	17/03/2014	4,800	100.754,42
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA EL	ES0378641015	FADE/5,00 BTA 20150617 2 GTIA	17/06/2015	5,000	100.901,97
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA EL	ES0378641023	FADE/5,90 BTA 20210317 3 GTIA	17/03/2021	5,900	94.918,51
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA EL	ES0378641031	FADE/5,60 BTA 20180917 4 GTIA	17/09/2018	5,600	99.807,75
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA EL	ES0378641049	FADE/4,40 BTA 20130917 5 GTIA	17/09/2013	4,400	99.888,26
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA EL	ES0378641056	FADE/5,00 BTA 20261217 6 GTIA	17/12/2026	5,000	79.365,49
FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA EL	ES0378641064	FADE/5,00 BTA 20260617 7 GTIA	17/06/2026	5,000	82.081,00
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA HIPOCAT 3	ES0338675004	HIPOCAT.3/VAR BTH 20340415 A GTIA	15/04/2034	V	6.017,93
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 10	ES0338146006	UCI.10/VAR BTH 20360622 A GTIA	22/06/2036	V	21.412,11
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 10	ES0338146014	UCI.10/VAR BTH 20360622 B GTIA	22/06/2036	V	40.066,21
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 12	ES0338147004	UCI.12/VAR BTH 20391215 A GTIA	15/12/2039	V	24.371,24
FTPYME BANCAJA 3, F.T.A.	ES0304501044	PYME.BANCAJA.3/VAR BTA 20371213 C	13/12/2037	V	6.405,10
GAT FTGENCAT 2008, F.T.A.	ES0341071027	GAT.GENCAT.08/VAR BTA 20480128 B	28/01/2048	V	60.220,00
GAT FTGENCAT 2009, F.T.A.	ES0341064006	GAT.GENCAT.09/VAR BTA 20470120 A1G	20/01/2047	V	38.183,90
GC FTPYME PASTOR 4, F.T.A.	ES0332233032	GC.PYME.PAS.4/VAR BTA 20450715 B	15/07/2045	V	86.510,00
GC FTPYME PASTOR 4, F.T.A.	ES0332233040	GC.PYME.PAS.4/VAR BTA 20450715 C	15/07/2045	V	12.050,01
GC FTPYME SABADELL 5, F.T.A.	ES0332234014	GC.PYME.SAB.5/VAR BTA 20390331 A2	31/03/2039	V	16.918,60
GC FTPYME SABADELL 6, F.T.A.	ES0341099010	GC.PYME.SAB.6/VAR BTA 20390930 A2	30/09/2039	V	21.722,95
HIPOCAT 10, F.T.A.	ES0345671012	HIPOCAT.10/VAR BTA 20391024 A2 GTIA	24/10/2039	V	39.483,90
HIPOCAT 11, F.T.A.	ES0345672044	HIPOCAT.11/VAR BTA 20500115 C GTIA	15/01/2050	V	28.406,88
HIPOCAT 15, F.T.A.	ES0345675021	HIPOCAT.15/VAR BTA 20480229 C GTIA	09/02/2012	V	41.049,71
HIPOCAT 16, F.T.A.	ES0345676011	HIPOCAT.16/VAR BTA 20510315 B GTIA	15/03/2051	V	28.615,63
HIPOCAT 17, F.T.A.	ES0345677001	HIPOCAT.17/VAR BTA 20520920 A GTIA	20/09/2052	V	53.979,35
HIPOCAT 17, F.T.A.	ES0345677019	HIPOCAT.17/VAR BTA 20520920 B GTIA	20/09/2052	V	32.883,17
HIPOCAT 6, F.T.A.	ES0345782017	HIPOCAT.6/VAR BTA 20341215 B GTIA	15/12/2034	V	43.672,43
HIPOCAT 7, F.T.A.	ES0345783031	HIPOCAT.7/VAR BTA 20360715 C GTIA	15/07/2036	V	25.278,58
HIPOCAT 8, F.T.A.	ES0345784013	HIPOCAT.8/VAR BTA 20380315 A2 GTIA	15/03/2038	V	32.383,29
HIPOCAT 8, F.T.A.	ES0345784021	HIPOCAT.8/VAR BTA 20380315 B GTIA	15/03/2038	V	73.164,21
HIPOCAT 8, F.T.A.	ES0345784047	HIPOCAT.8/VAR BTA 20380315 D GTIA	15/03/2038	V	24.811,55
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0314954084	IBERCAJA/4,44 BO 20140730 GTIA	30/07/2014	4,440	49.281,15
IM BANCO POPULAR FTPYME 1, F.T.A.	ES0347847016	IM.POP.PYME/VAR BTA 20430424 AG	24/04/2043	V	36.903,33
IM CAJAMAR 3, F.T.A.	ES0347783005	IM.CAJAMAR.3/VAR BTA 20480922 A	22/09/2048	V	44.154,74
IM CAJAMAR 4, F.T.A.	ES0349044000	IM.CAJAMAR.4/VAR BTA 20490322 A	22/03/2049	V	51.566,15
IM CEDULAS 1 GRUPO BANCO POPULAR, F.T.A.	ES0347858005	IM.CEDULAS.1/4,25 BTA 20140212 GTIA	12/02/2014	4,250	98.691,48
IM CEDULAS 10, F.T.A.	ES0349045007	IM.CED.10/4,50 BTA 20220221 GTIA	21/02/2022	4,500	74.080,00
IM CEDULAS 15, F.T.A.	ES0347463004	IM.CED.15/3,85 BTA 20131223 GTIA	23/12/2013	3,850	48.639,32
IM CEDULAS 2, F.T.A.	ES0347859003	IM.CEDULAS.2/4,50 BTA 20140611 A	11/06/2014	4,500	95.602,67
IM CEDULAS 3, F.T.A.	ES0347852008	IM.CED.3/4,00 BTA 20141119 GTIA	19/11/2014	4,000	94.616,66
IM CEDULAS 4, F.T.A.	ES0347848006	IM.CED.4/3,75 BTA 20150311 A GTIA	11/03/2015	3,750	92.362,76
IM CEDULAS 7, F.T.A.	ES0347784003	IM.CED.7/4,00 BTA 20210331 GTIA	31/03/2021	4,000	72.803,83
IM CEDULAS 9, F.T.A.	ES0347785000	IM.CED.9/4,25 BTA 20160609 GTIA	09/06/2016	4,250	89.786,38
IM FTGENCAT SABADELL 3, F.T.A.	ES0347568018	IM.GENCAT.SAB.3/VAR BTA 20400618 A2	18/06/2040	V	54.485,21
IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I, F.T.A.	ES0347844021	IM.POP.PYME.I/VAR BTA 20390921 A3	21/09/2039	V	5.488,32
IM PASTOR 3, F.T.H.	ES0347862007	IM.PAS.3/VAR BTH 20430322 A GTIA	22/03/2043	V	24.573,73
IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, F.T.A.	ES0347787006	IM.PREST.F.CED./VAR BTA 20220124 A	24/01/2022	V	48.409,53
IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, F.T.A.	ES0347787014	IM.PREST.F.CED./VAR BTA 20220124 B	24/01/2022	V	43.080,87
IM TERRASSA MBS 1, F.T.A.	ES0347855001	IM.TERR.MBS.1/VAR BTA 20490724 A	24/07/2049	V	31.648,36
INTERMONEY MASTER CEDULAS, F.T.A.	ES0362859003	INTER.MAST.CED/3,50 BTA 20151202 M1	02/12/2015	3,500	89.839,44
KUTXABANK, S.A.U.	ES0314100068	BBK/4,38 BO 20150928	28/09/2015	4,380	95.646,81
KUTXABANK, S.A.U.	ES0314100076	BBK/4,40 BO 20160301	01/03/2016	4,400	93.585,92
KUTXABANK, S.A.U.	ES0315308199	CA.VITAL/VAR BO 20120323	23/03/2012	V	49.981,41
KUTXABANK, S.A.U.	ES0315308207	CA.VITAL/2,479 BO 20120924 GTIA	24/09/2012	2,479	49.125,00
KUTXABANK, S.A.U.	ES0315308215	CA.VITAL/VAR BO 20130327	27/03/2013	V	49.999,97

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
LIBERBANK, S.A.	ES0314826043	CAJASTUR/VAR BO 20121214 GTIA	14/12/2012	V	48.913,99
LIBERBANK, S.A.	ES0314826068	CAJASTUR/3,50 BO 20131008 GTIA	08/10/2013	3,500	48.951,90
LIBERBANK, S.A.	ES0314826076	CAJASTUR/4,50 BO 20140224 GTIA	24/02/2014	4,500	49.627,82
LIBERBANK, S.A.	ES0314975022	CA.CANTABRIA/VAR BO 20120412	12/04/2012	V	48.502,76
LIBERBANK, S.A.	ES0314975063	CA.CANTABRIA/4,875 BO 20150202 GTIA	02/02/2015	4,875	49.239,23
MBS BANCAJA 2, F.T.A.	ES0361795000	MBS.BANCAJA.2/VAR BTA 20380225 A	25/02/2038	V	24.456,94
NCG BANCO, S.A.	ES0314843303	CAIXAGALICIA/3,25 BO 20120417 GTIA	17/04/2012	3,250	49.808,13
NCG BANCO, S.A.	ES0314843329	CAIXAGALICIA/3,00 BO 20141103 GTIA	03/11/2014	3,000	47.557,56
NCG BANCO, S.A.	ES0314958036	CAIXANOVA/VAR BO 20120302	02/03/2012	V	49.031,25
NCG BANCO, S.A.	ES0314958051	CAIXANOVA/3,125 BO 20120319 GTIA	19/03/2012	3,125	49.643,12
NCG BANCO, S.A.	ES0314958069	CAIXANOVA/3,125 BO 20150415 GTIA	15/04/2015	3,125	47.244,25
POPULAR CAPITAL, S.A.	ES0370412001	POP.CAP./VAR BOSUBDCANJ 20131023	23/10/2013	V	409,74
POPULAR CAPITAL, S.A.	ES0370412019	POP.CAP./8,00 BOSUBDCANJ 20131217	17/12/2013	8,000	894,78
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622004	PROG.CED.TDA/VAR BTA 20160408 A1	08/04/2016	V	77.406,96
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622012	PROG.CED.TDA/4,13 BTA 20210410 A4	10/04/2021	4,125	72.551,04
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622020	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20310410 A6	10/04/2031	4,250	57.654,09
PROGRAMA CEDULAS TDA, F.T.A.	ES0371622046	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20270328 A5	28/03/2027	4,250	56.189,98
PYMES BANESTO 2, F.T.A.	ES0372260010	PYMES.BTO.2/VAR BTA 20311231 A2	31/12/2031	V	40.641,04
RENTA 4 BANCO, S.A.	ES0373358003	R4/5,00 BOCONV 20140328	28/03/2014	5,000	1.060,26
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, F.T.A.	ES0374273003	RURAL.HIP.GBL.I/VAR BTA 20390118 A	18/01/2039	V	36.090,95
RURAL HIPOTECARIO III, F.T.H.	ES0358282004	RURAL.HIP.III/VAR BTH 20320313 A	13/03/2032	V	14.922,74
RURAL HIPOTECARIO IV, F.T.H.	ES0358283002	RURAL.HIP.IV/VAR BTH 20330213 A	13/02/2033	V	18.079,76
RURAL HIPOTECARIO IX, F.T.A.	ES0374274019	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 A2	17/02/2050	V	54.898,62
RURAL HIPOTECARIO IX, F.T.A.	ES0374274035	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 B	17/02/2050	V	53.320,00
RURAL HIPOTECARIO V, F.T.H.	ES0358284000	RURAL.HIP.V/VAR BTH 20350315 A1	15/03/2035	V	24.165,79
RURAL HIPOTECARIO VII, F.T.A.	ES0366366005	RURAL.HIP.VII/VAR BTA 20380315 A1	15/03/2038	V	33.142,67
RURAL HIPOTECARIO VIII, F.T.A.	ES0366366021	RURAL.HIP.VIII/VAR BTA 20380315 B	15/03/2038	V	27.673,70
RURAL HIPOTECARIO VIII, F.T.A.	ES0366367011	RURAL.HIP.VIII/VAR BTA 20440119 A2A	19/01/2044	V	45.082,60
RURAL HIPOTECARIO VIII, F.T.A.	ES0366367045	RURAL.HIP.VIII/VAR BTA 20440119 C	19/01/2044	V	63.236,00
RURALPYME 2 FTPYME, F.T.A.	ES0374352005	RURALPYME.2/VAR BTA 20300425 A1	25/04/2030	V	12.304,08
RURALPYME 2 FTPYME, F.T.A.	ES0374352039	RURALPYME.2/VAR BTA 20300425 C	25/04/2030	V	79.389,87
SANTANDER EMISORA 150, S.A. UNIPERSONAL	ES0307779001	SAN.EMISORA.150/VAR BOCAN 20121004	04/10/2012	V	2.156,76
SANTANDER HIPOTECARIO I, F.T.A.	ES0309364000	SAN.HIP.I/VAR BTA 20420715 A GTIA	15/07/2042	V	25.815,30
SANTANDER HIPOTECARIO I, F.T.A.	ES0309364026	SAN.HIP.I/VAR BTA 20420715 C GTIA	15/07/2042	V	46.005,11
TDA 11, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0378014023	TDA.11/VAR BTH 20120726 A3 GTIA	26/07/2012	V	8.894,11
TDA 11, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0378014031	TDA.11/VAR BTH 20120726 B GTIA	26/07/2012	V	69.724,36
TDA 12, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0377976024	TDA.12/VAR BTH 20300426 A3 GTIA	26/04/2030	V	12.409,27
TDA 13-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377977014	TDA.13-MIXTO/VAR BTH 20151026 B1	26/10/2015	V	56.758,09
TDA 14-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377978020	TDA.14-MIXTO/VAR BTH 20310126 A3	26/01/2031	V	20.757,33
TDA 14-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377978038	TDA.14-MIXTO/VAR BTH 20310126 B1	26/01/2031	V	72.129,41
TDA 19-MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377964004	TDA.19-MIXTO/VAR BTA 20360322 A	22/03/2036	V	25.742,83
TDA 22-MIXTO, F.T.A.	ES0377983053	TDA.22-MIXTO/VAR BTA 20460628 A2A	28/06/2046	V	10.979,15
TDA 24, F.T.A.	ES0377952025	TDA.24/VAR BTA 20400622 B GTIA	22/06/2040	V	19.503,16
TDA 27, F.T.A.	ES0377954013	TDA.27/VAR BTA 20501228 A2 GTIA	28/12/2050	V	62.584,15
TDA 27, F.T.A.	ES0377954039	TDA.27/VAR BTA 20501228 B GTIA	28/12/2050	V	51.479,00
TDA CAM 4, F.T.A.	ES0377991007	TDA.CAM.4/VAR BTA 20390626 A GTIA	26/06/2039	V	27.516,30
TDA CAM 6, F.T.A.	ES0377993003	TDA.CAM.6/VAR BTA 20120728 A1 GTIA	28/07/2012	V	11.029,16
TDA CAM 7, F.T.A.	ES0377994019	TDA.CAM.7/VAR BTA 20490226 A2 GTIA	26/02/2049	V	50.629,26
TDA IBERCAJA 1, F.T.A.	ES0338450002	TDA.IBERCAJA.1/VAR BTA 20350726 A	26/07/2035	V	25.434,05
TDA IBERCAJA 2, F.T.A.	ES0338451000	TDA.IBERCAJA.2/VAR BTA 20421026 A	26/10/2042	V	42.834,95
TDA IBERCAJA 3, F.T.A.	ES0338452008	TDA.IBERCAJA.3/VAR BTA 20431228 A	28/12/2043	V	43.666,73
TDA IBERCAJA 5, F.T.A.	ES0377967031	TDA.IBERCAJA.5/VAR BTA 20491126 C	26/11/2049	V	37.197,16
TDA PASTOR CONSUMO 1, F.T.A.	ES0338454004	PASTOR.CONSUMO.1/VAR BTA 20210128 A	28/01/2021	V	15.024,73
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0364872095	UNICAJA/3,00 BO 20120618 GTIA	18/06/2012	3,000	49.585,95
VALENCIA HIPOTECARIO 2, F.T.H.	ES0382745000	VALENCIA.HIP.2/VAR BTH 20430124 A	24/01/2043	V	33.756,42
VALENCIA HIPOTECARIO 3, F.T.A.	ES0382746032	VALENCIA.HIP.3/VAR BTA 20440922 C	22/09/2044	V	39.988,63
ZINKIA ENTERTAINMENT, S.A.	ES0384849008	ZNK/9,75 BO 20131112	12/11/2013	9,750	967,88

CEDULAS

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211030	BBVA/4,25 CEDHIP 20130129 GTIA	29/01/2013	4,250	100.017,70
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211055	BBVA/4,25 CEDHIP 20140715 GTIA	15/07/2014	4,250	99.965,32
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211071	BBVA/4,00 CEDHIP 20250225 GTIA	25/02/2025	4,000	84.534,58
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211089	BBVA/3,50 CEDHIP 20150225 GTIA	25/02/2015	3,500	98.342,47
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211105	BBVA/3,50 CEDHIP 20201007 GTIA	07/10/2020	3,500	88.125,39
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211113	BBVA/3,25 CEDHIP 20160124 GTIA	24/01/2016	3,250	95.158,21
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211121	BBVA/3,50 CEDHIP 20210124 GTIA	24/01/2021	3,500	84.723,09
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211139	BBVA/3,875 CEDHIP 20120531 GTIA	31/05/2012	3,875	100.557,13
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211154	BBVA/3,75 CEDHIP 20131004 GTIA	04/10/2013	3,750	99.625,44
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211170	BBVA/4,25 CEDHIP 20170118 GTIA	18/01/2017	4,250	95.799,93
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211204	BBVA/4,50 CEDTER 20140530 GTIA	30/05/2014	4,500	50.491,65
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211261	BBVA/4,625 CEDTER 20120802 GTIA	02/08/2012	4,625	100.950,19
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211337	BBVA/3,00 CEDHIP 20141009 GTIA	09/10/2014	3,000	48.476,82
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211345	BBVA/3,625 CEDHIP 20170118 GTIA	18/01/2017	3,625	47.204,89
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211352	BBVA/2,50 CEDTER 20131007 GTIA	07/10/2013	2,500	48.667,66
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211386	BBVA/3,50 CEDTER 20130726 GTIA	26/07/2013	3,500	49.705,19
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211410	BBVA/4,125 CEDHIP 20140113 GTIA	13/01/2014	4,125	50.061,22
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211428	BBVA/4,75 CEDHIP 20160210 GTIA	10/02/2016	4,750	50.452,08
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211469	BBVA/4,25 CEDHIP 20150330 GTIA	30/03/2015	4,250	49.802,35
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211493	BBVA/4,33 CEDTER 20121031 GTIA	31/10/2012	4,330	100.856,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211501	BBVA/4,33 CEDTER 20121207 GTIA	07/12/2012	4,330	100.990,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211550	BBVA/4,00 CEDTER 20160921 GTIA	21/09/2016	4,000	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211568	BBVA/4,25 CEDTER 20180921 GTIA	21/09/2018	4,250	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211576	BBVA/3,50 CEDTER 20140922 GTIA	22/09/2014	3,500	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211584	BBVA/3,75 CEDTER 20150922 GTIA	22/09/2015	3,750	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211600	BBVA/3,00 CEDTER 20130927 GTIA	27/09/2013	3,000	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211618	BBVA/4,00 CEDTER 20160927 GTIA	27/09/2016	4,000	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211626	BBVA/3,75 CEDTER 20150928 GTIA	28/09/2015	3,750	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211634	BBVA/3,50 CEDTER 20140928 GTIA	28/09/2014	3,500	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211642	BBVA/3,00 CEDTER 20130930 GTIA	30/09/2013	3,000	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211659	BBVA/3,50 CEDTER 20140930 GTIA	30/09/2014	3,500	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211667	BBVA/3,25 CEDHIP 20131010 GTIA	10/10/2013	3,250	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211675	BBVA/3,50 CEDHIP 20141010 GTIA	10/10/2014	3,500	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211683	BBVA/3,75 CEDHIP 20151010 GTIA	10/10/2015	3,750	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211691	BBVA/3,25 CEDHIP 20131220 GTIA	20/12/2013	3,250	100.000,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211709	BBVA/3,25 CEDTER 20131223 GTIA	23/10/2012	3,250	100.000,00
BANCO CAM, S.A.	ES0414400079	CAM/3,375 CEDHIP 20141022 GTIA	22/10/2014	3,375	46.000,07
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0414854036	CAJADUERO/VAR CEDHIP 20120629 GTIA	29/06/2012	V	985,20
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0414854044	CAJADUERO/VAR CEDHIP 20120929 GTIA	29/09/2012	V	976,88
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0414854085	CAJADUERO/3,00 CEDHIP 20130610 GTIA	10/06/2013	3,000	989,95
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0415474305	CA.ESPAÑA/3,00 CEDHIP 20150603 GTIA	03/06/2015	3,000	935,73
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0458673011	CA.ESP.DUERO/VAR CEDHIP 20140630	30/06/2014	V	1.000,24
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0458673029	CA.ESP.DUERO/VAR CEDHIP 20140915	15/09/2014	V	100.000,00
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0458673037	CA.ESP.DUERO/4,25 CEDHIP 20150430	30/04/2015	4,250	49.941,73
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0458673045	CA.ESP.DUERO/5,50 CEDHIP 20170417	17/04/2017	5,500	50.000,00
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0458673052	CA.ESP.DUERO/6,00 CEDHIP 20190517	17/05/2019	6,000	50.000,00
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0458673060	CA.ESP.DUERO/5,75 CEDTER 20180517	17/05/2018	5,750	50.000,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860000	SAB/4,50 CEDHIP 20130429 GTIA	29/04/2013	4,500	100.883,20
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860026	SAB/3,25 CEDHIP 20150615 GTIA	15/06/2015	3,250	94.759,39
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860034	SAB/3,50 CEDHIP 20160119 GTIA	19/01/2016	3,500	92.140,17
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860067	SAB/4,25 CEDHIP 20170124 GTIA	24/01/2017	4,250	96.296,87
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860174	SAB/VAR CEDHIP 20180918 GTIA	18/09/2018	V	86.404,65
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860182	SAB/3,125 CEDHIP 20140120 GTIA	20/01/2014	3,125	97.160,57
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860208	SAB/3,25 CEDHIP 20120910 GTIA	10/09/2012	3,250	49.652,49
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860232	SAB/4,50 CEDHIP 20130211 GTIA	11/02/2013	4,500	100.080,34
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440027	BTO/5,75 CEDHIP 20170327 GTIA	27/03/2017	5,750	107.121,22
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440050	BTO/4,25 CEDHIP 20140916 GTIA	16/09/2014	4,250	99.135,33
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440068	BTO/3,50 CEDHIP 20150127 GTIA	27/01/2015	3,500	97.325,08
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440076	BTO/2,75 CEDHIP 20120907 GTIA	07/09/2012	2,750	99.259,23
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440084	BTO/3,50 CEDHIP 20160118 GTIA	18/01/2016	3,500	96.951,49
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440092	BTO/4,25 CEDHIP 20130712 GTIA	12/07/2013	4,250	99.644,35
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440100	BTO/4,25 CEDHIP 20140221 GTIA	21/02/2014	4,250	100.363,70
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440159	BTO/3,625 CEDHIP 20130604 GTIA	04/06/2013	3,625	99.478,91
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440167	BTO/2,625 CEDHIP 20130228 GTIA	28/02/2013	2,625	49.201,10
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440175	BTO/3,625 CEDHIP 20150907 GTIA	07/09/2015	3,625	96.818,33
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440217	BTO/4,625 CEDHIP 20150330 GTIA	30/03/2015	4,625	100.893,71
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440233	BTO/4,25 CEDTER 20161020 GTIA	20/10/2016	4,250	100.000,00
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440241	BTO/4,75 CEDHIP 20171214 GTIA	14/12/2017	4,750	100.139,63
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0413056005	MARE.NOSTRUM/VAR CEDHIP 20161222	22/12/2016	V	100.000,00
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0414600082	CA.MURCIA/VAR CEDHIP 20131014 GTIA	14/10/2013	V	99.644,55
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770001	PAS/3,75 CEDHIP 20150304 GTIA	04/03/2015	3,750	88.415,62
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770019	PAS/3,875 CEDHIP 20130920 GTIA	20/09/2013	3,875	93.824,72
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770092	PAS/3,25 CEDHIP 20140317 GTIA	17/03/2014	3,250	90.603,70
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770134	PAS/3,625 CEDHIP 20120924 GTIA	24/09/2012	3,625	98.752,20
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790009	POP/3,00 CEDHIP 20121018 GTIA	18/10/2012	3,000	98.864,84
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790017	POP/4,00 CEDHIP 20161018 GTIA	18/10/2016	4,000	95.838,46
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790058	POP/4,375 CEDHIP 20140616 GTIA	16/06/2014	4,375	49.815,93
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790074	POP/4,125 CEDHIP 20180409 GTIA	09/04/2018	4,125	46.487,21
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790108	POP/3,50 CEDHIP 20130913 GTIA	13/09/2013	3,500	49.492,72
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790116	POP/4,25 CEDHIP 20150930 GTIA	30/09/2015	4,250	49.312,65
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790124	POP/4,50 CEDHIP 20130204 GTIA	04/02/2013	4,500	50.049,68
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790140	POP/3,50 CEDHIP 20131025 GTIA	25/10/2013	3,500	50.000,00
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790157	POP/3,75 CEDHIP 20141025 GTIA	25/10/2014	3,750	50.000,00
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790165	POP/4,00 CEDHIP 20151025 GTIA	25/10/2015	4,000	50.000,00
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900020	SAN/4,00 CEDTER 20130708 GTIA	08/07/2013	4,000	100.075,02

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900061	SAN/4,50 CEDHIP 20160729 GTIA	29/07/2016	4,500	99.471,67
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900079	SAN/3,25 CEDHIP 20120207 GTIA	07/02/2012	3,250	100.068,98
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900087	SAN/4,00 CEDHIP 20200407 GTIA	07/04/2020	4,000	89.802,77
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900103	SAN/3,125 CEDHIP 20150928 GTIA	28/09/2015	3,125	94.774,86
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900111	SAN/3,50 CEDHIP 20140206 GTIA	06/02/2014	3,500	98.675,51
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900129	SAN/3,875 CEDHIP 20260206 GTIA	06/02/2026	3,875	80.737,13
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900145	SAN/4,125 CEDHIP 20170109 GTIA	09/01/2017	4,125	96.585,15
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900152	SAN/4,25 CEDHIP 20130506 GTIA	06/05/2013	4,250	100.756,41
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900160	SAN/4,625 CEDHIP 20270504 GTIA	04/05/2027	4,625	89.780,90
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900178	SAN/4,50 CEDHIP 20121114 GTIA	14/11/2012	4,500	101.211,16
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900186	SAN/3,875 CEDHIP 20140527 GTIA	27/05/2014	3,875	99.263,91
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900202	SAN/3,125 CEDHIP 20150128 GTIA	28/01/2015	3,125	96.776,27
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900210	SAN/3,625 CEDHIP 20170406 GTIA	06/04/2017	3,625	94.729,64
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900228	SAN/4,625 CEDHIP 20160120 GTIA	20/01/2016	4,625	100.435,39
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900244	SAN/4,375 CEDHIP 20150316 GTIA	16/03/2015	4,375	100.740,77
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900251	SAN/4,625 CEDTER 20160621 GTIA	21/06/2016	4,625	99.627,28
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900277	SAN/4,25 CEDHIP 20140901 GTIA	01/09/2014	4,250	100.000,00
BANKIA, S.A.	ES0414950560	CA.MADRID/5,75 CEDHIP 20160629 GTIA	29/06/2016	5,750	102.000,00
BANKIA, S.A.	ES0414950586	CA.MADRID/5,25 CEDHIP 20120301 GTIA	01/03/2012	5,250	100.389,80
BANKIA, S.A.	ES0414950594	CA.MADRID/5,00 CEDHIP 20141030 GTIA	30/10/2014	5,000	99.157,14
BANKIA, S.A.	ES0414950628	CA.MADRID/4,00 CEDHIP 20250203 GTIA	03/02/2025	4,000	77.833,00
BANKIA, S.A.	ES0414950636	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20151214 GTIA	14/12/2015	3,500	91.268,84
BANKIA, S.A.	ES0414950644	CA.MADRID/4,125 CEDHIP 20360324	24/03/2036	4,125	34.275,50
BANKIA, S.A.	ES0414950651	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20180525 GTIA	25/05/2018	4,250	44.388,22
BANKIA, S.A.	ES0414950669	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20160705 GTIA	05/07/2016	4,250	47.108,48
BANKIA, S.A.	ES0414950677	CA.MADRID/4,25 CEDTER 20140221 GTIA	21/02/2014	4,250	48.931,13
BANKIA, S.A.	ES0414950685	CA.MADRID/4,50 CEDHIP 20220426 GTIA	26/04/2022	4,500	42.014,37
BANKIA, S.A.	ES0414950693	CA.MADRID/5,00 CEDHIP 20190628 GTIA	28/06/2019	5,000	46.036,25
BANKIA, S.A.	ES0414950776	CA.MADRID/3,625 CEDHIP 20161005	05/10/2016	3,625	45.009,61
BANKIA, S.A.	ES0414950784	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20141113 GTIA	13/11/2014	3,500	47.149,49
BANKIA, S.A.	ES0414950826	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20130314 GTIA	14/03/2013	3,500	49.294,01
BANKIA, S.A.	ES0414950842	CA.MADRID/4,875 CEDHIP 20140331	31/03/2014	4,875	49.631,68
BANKIA, S.A.	ES0414977258	BANCAJA/4,375 CEDHIP 20150128 GTIA	28/01/2015	4,375	96.344,18
BANKIA, S.A.	ES0414977266	BANCAJA/4,50 CEDHIP 20130411 GTIA	11/04/2013	4,500	99.450,82
BANKIA, S.A.	ES0414977357	BANCAJA/3,00 CEDHIP 20130415 GTIA	15/04/2013	3,000	48.753,81
BANKINTER, S.A.	ES0413679061	BKT/3,25 CEDHIP 20141113 GTIA	13/11/2014	3,250	96.027,46
BANKINTER, S.A.	ES0413679079	BKT/2,625 CEDHIP 20130409 GTIA	09/04/2013	2,625	48.806,44
BANKINTER, S.A.	ES0413679095	BKT/3,75 CEDHIP 20130923 GTIA	23/09/2013	3,750	49.529,58
BANKINTER, S.A.	ES0413679111	BKT/4,875 CEDHIP 20130121 GTIA	21/01/2013	4,875	50.387,07
BANKINTER, S.A.	ES0413679129	BKT/4,25 CEDHIP 20150330 GTIA	30/03/2015	4,250	49.364,32
BANKINTER, S.A.	ES0413679137	BKT/4,25 CEDHIP 20140115 GTIA	15/01/2014	4,250	50.000,00
BANKINTER, S.A.	ES0413679145	BKT/4,25 CEDHIP 20140203 GTIA	03/02/2014	4,250	49.700,00
CAIXABANK, S.A.	ES0414970162	LACAIXA/4,50 CEDHIP 20121121 GTIA	21/11/2012	4,500	100.491,37
CAIXABANK, S.A.	ES0414970188	LACAIXA/4,25 CEDHIP 20131031 GTIA	31/10/2013	4,250	99.968,24
CAIXABANK, S.A.	ES0414970196	LACAIXA/4,75 CEDHIP 20181031 GTIA	31/10/2018	4,750	95.743,80
CAIXABANK, S.A.	ES0414970204	LACAIXA/3,875 CEDHIP 20250217 GTIA	17/02/2025	3,875	94.112,63
CAIXABANK, S.A.	ES0414970212	LACAIXA/3,25 CEDHIP 20151005 GTIA	05/10/2015	3,250	94.117,48
CAIXABANK, S.A.	ES0414970238	LACAIXA/3,375 CEDHIP 20140630 GTIA	30/06/2014	3,375	48.320,75
CAIXABANK, S.A.	ES0414970246	LACAIXA/3,625 CEDHIP 20210118 GTIA	18/01/2021	3,625	40.250,00
CAIXABANK, S.A.	ES0414970253	LACAIXA/VAR CEDHIP 20160630 GTIA	30/06/2016	V	1.000,00
CAIXABANK, S.A.	ES0414970279	LACAIXA/VAR CEDHIP 20130820 GTIA	20/08/2013	V	46.759,00
CAIXABANK, S.A.	ES0414970287	LACAIXA/VAR CEDHIP 20130620 GTIA	20/06/2013	V	94.450,00
CAIXABANK, S.A.	ES0414970295	LACAIXA/4,25 CEDHIP 20170126 GTIA	26/01/2017	4,250	48.079,06
CAIXABANK, S.A.	ES0414970303	LACAIXA/4,50 CEDHIP 20220126 GTIA	26/01/2022	4,500	43.137,50
CAIXABANK, S.A.	ES0414970337	LACAIXA/VAR CEDHIP 20160930 GTIA	30/09/2016	V	1.000,00
CAIXABANK, S.A.	ES0414970352	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170330 GTIA	30/03/2017	V	1.000,00
CAIXABANK, S.A.	ES0414970394	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170930 GTIA	30/09/2017	V	1.000,00
CAIXABANK, S.A.	ES0414970402	LACAIXA/4,625 CEDHIP 20190604 GTIA	04/06/2019	4,625	47.897,41
CAIXABANK, S.A.	ES0414970428	LACAIXA/VAR CEDHIP 20120330 GTIA	30/03/2012	V	1.000,01
CAIXABANK, S.A.	ES0414970519	LACAIXA/3,75 CEDHIP 20140526 GTIA	26/05/2014	3,750	49.114,57
CAIXABANK, S.A.	ES0414970535	LACAIXA/3,50 CEDHIP 20160331 GTIA	31/03/2016	3,500	46.787,80
CAIXABANK, S.A.	ES0414970550	LACAIXA/2,50 CEDTER 20130429 GTIA	29/04/2013	2,500	48.622,71
CAIXABANK, S.A.	ES0414970584	LACAIXA/3,125 CEDHIP 20130916 GTIA	16/09/2013	3,125	48.956,17
CAIXABANK, S.A.	ES0414970592	LACAIXA/VAR CEDHIP 20141006 GTIA	06/10/2014	V	99.519,33
CAIXABANK, S.A.	ES0414970600	LACAIXA/VAR CEDHIP 20151008 GTIA	08/10/2015	V	99.522,49
CAIXABANK, S.A.	ES0414970634	LACAIXA/4,706 CEDHIP 20140131 GTIA	31/01/2014	4,706	49.850,00
CAIXABANK, S.A.	ES0414970659	LACAIXA/5,00 CEDHIP 20160222 GTIA	22/02/2016	5,000	49.969,09
CAIXABANK, S.A.	ES0414970667	LACAIXA/4,75 CEDHIP 20150318 GTIA	18/03/2015	4,750	50.148,88
CAIXABANK, S.A.	ES0414970683	LACAIXA/5,125 CEDHIP 20160427 GTIA	27/04/2016	5,125	50.253,52
CAIXABANK, S.A.	ES0440609008	CABK/4,25 CEDTER 20150619 GTIA	19/06/2015	4,250	49.930,06
CAIXABANK, S.A.	ES0440609016	CABK/3,875 CEDTER 20140320 GTIA	20/03/2014	3,875	49.915,06
CAIXABANK, S.A.	ES0440609024	CABK/4,25 CEDHIP 20170126 GTIA	26/01/2017	4,250	48.119,50
CAJAMAR CAJA RURAL, S. COOP. DE CREDITO	ES0414601023	CAJAMAR/3,50 CEDHIP 20141023 GTIA	23/10/2014	3,500	93.720,13
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0414840274	CA.CATALUNYA/3,50 CEDHIP 20160307	07/03/2016	3,500	85.085,03
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0414840308	CA.CATALUNYA/4,875 CEDHIP 20170629	29/06/2017	4,875	86.093,69
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0418538007	CATALUNYA.CAIXA/VAR CEDHIP 20140317	17/03/2014	V	50.003,15
DEXIA SABADELL, S.A.	ES0426396158	DEXIA.SAB/VAR CEDTER 20120114 GTIA	14/01/2012	V	99.814,64
DEXIA SABADELL, S.A.	ES0426396166	DEXIA.SAB/VAR CEDTER 20120828 GTIA	28/08/2012	V	99.341,49
DEXIA SABADELL, S.A.	ES0426396174	DEXIA.SAB/VAR CEDTER 20130103 GTIA	03/01/2013	V	99.475,27
DEXIA SABADELL, S.A.	ES0426396182	DEXIA.SAB/VAR CEDTER 20130421 GTIA	21/04/2013	V	99.863,07
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0414954141	IBERCAJA/3,375 CEDHIP 20141127 GTIA	27/11/2014	3,375	47.853,64
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0414954166	IBERCAJA/3,50 CEDHIP 20150422 GTIA	22/04/2015	3,500	47.402,17
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0444251005	IBERCAJA.BCO/VAR CEDHIP 20181205	05/12/2018	V	50.000,00
KUTXABANK, S.A.U.	ES0414100026	BBK/3,375 CEDHIP 20140929 GTIA	29/09/2014	3,375	96.795,16
KUTXABANK, S.A.U.	ES0414100109	BBK/VAR CEDHIP 20151026 GTIA CREC	26/10/2015	V	100.000,00

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
KUTXABANK, S.A.U.	ES0414100117	BBK/VAR CEDHIP 20151103 GTIA CREC	03/11/2015	V	100.000,00
KUTXABANK, S.A.U.	ES0415308024	CA.VITAL/2,826 CEDHIP 20121128 GTIA	28/11/2012	2,826	49.585,44
KUTXABANK, S.A.U.	ES0415308032	CA.VITAL/3,348 CEDHIP 20120127 GTIA	27/01/2012	3,348	49.940,00
KUTXABANK, S.A.U.	ES0415308057	CA.VITAL/4,50 CEDHIP 20130523 GTIA	23/05/2013	4,500	49.806,23
KUTXABANK, S.A.U.	ES0415309006	KUTXA/4,375 CEDHIP 20141105 GTIA	05/11/2014	4,375	49.650,36
KUTXABANK, S.A.U.	ES0415309014	KUTXA/5,125 CEDHIP 20150408 GTIA	08/04/2015	5,125	50.419,51
KUTXABANK, S.A.U.	ES0415309022	KUTXA/VAR CEDHIP 20191014 GTIA	14/10/2019	V	50.000,00
KUTXABANK, S.A.U.	ES0415309030	KUTXA/VAR CEDHIP 20151109 GTIA	09/11/2015	V	100.032,97
NCG BANCO, S.A	ES0414843146	CAIXAGALICIA/4,375 CEDHIP 20190123	23/01/2019	4,375	86.636,72
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0413495005	SAN.CONS.FIN/3,875 CEDHIP 20160323	23/03/2016	3,875	97.548,75
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0458759000	UNICAJA/4,375 CEDHIP 20151014 GTIA	14/10/2015	4,375	48.439,16
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0458759034	UNICAJA/5,50 CEDHIP 20160323 GTIA	23/03/2016	5,500	50.490,38
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0464872052	UNICAJA/3,32 CEDHIP 20130124 GTIA	24/01/2013	3,320	48.761,93
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0464872060	UNICAJA/3,125 CEDHIP 20141006 GTIA	06/10/2014	3,125	48.184,29

PAGARÉS

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCA CIVICA, S.A.	ES0548873506	BCA.CIVICA/PAG 20120313	13/03/2012	C	49.360,08
BANCA CIVICA, S.A.	ES0548873563	BCA.CIVICA/PAG 20121019	19/10/2012	C	48.313,65
BANCA CIVICA, S.A.	ES0548873613	BCA.CIVICA/PAG 20121102	02/11/2012	C	48.430,33
BANCA CIVICA, S.A.	ES0548873639	BCA.CIVICA/PAG 20130503	03/05/2013	C	47.115,99
BANCA CIVICA, S.A.	ES0548873662	BCA.CIVICA/PAG 20120305	05/03/2012	C	49.661,08
BANCA MARCH, S.A.	ES05130458J4	BCA.MARCH/PAG 20120316	16/03/2012	C	987,92
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0513377210	BCO.COOP.ESP/PAG 20121024	24/10/2012	C	48.309,18
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0513377251	BCO.COOP.ESP/PAG 20121114	14/11/2012	C	48.355,90
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0513377277	BCO.COOP.ESP/PAG 20130508	08/05/2013	C	47.518,91
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0513377350	BCO.COOP.ESP/PAG 20120528	28/05/2012	C	49.182,96
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0513377368	BCO.COOP.ESP/PAG 20121128	28/11/2012	C	48.235,99
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0513377376	BCO.COOP.ESP/PAG 20130522	22/05/2013	C	47.349,61
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0513377384	BCO.COOP.ESP/PAG 20120227	27/02/2012	C	49.623,75
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0513377392	BCO.COOP.ESP/PAG 20121205	05/12/2012	C	48.251,81
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0513377400	BCO.COOP.ESP/PAG 20121212	12/12/2012	C	48.210,65
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0513377434	BCO.COOP.ESP/PAG 20120620	20/06/2012	C	49.174,08
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0513377442	BCO.COOP.ESP/PAG 20121219	19/12/2012	C	48.224,24
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0513377459	BCO.COOP.ESP/PAG 20130619	19/06/2013	C	47.174,10
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0513377467	BCO.COOP.ESP/PAG 20120328	28/03/2012	C	49.624,76
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0513377475	BCO.COOP.ESP/PAG 20121227	27/12/2012	C	48.161,84
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673010	CA.ESPAÑA.DUERO/PAG 20130107	07/01/2013	C	962,61
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673028	CA.ESPAÑA.DUERO/PAG 20130108	08/01/2013	C	962,08
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673069	CA.ESPAÑA.DUERO/PAG 20130109	09/01/2013	C	960,56
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673077	CA.ESPAÑA.DUERO/PAG 20130110	10/01/2013	C	960,24
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673085	CA.ESPAÑA.DUERO/PAG 20120709	09/07/2012	C	979,58
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673093	CA.ESPAÑA.DUERO/PAG 20130408	08/04/2013	C	954,12
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673101	CA.ESPAÑA.DUERO/PAG 20120710	10/07/2012	C	979,97
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673119	CA.ESPAÑA.DUERO/PAG 20130409	09/04/2013	C	953,57
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673127	CA.ESPAÑA.DUERO/PAG 20130410	10/04/2013	C	950,48
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673135	CA.ESPAÑA.DUERO/PAG 20120711	11/07/2012	C	978,34
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673143	CA.ESPAÑA.DUERO/PAG 20130411	11/04/2013	C	951,35
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673150	CA.ESPAÑA.DUERO/PAG 20120712	12/07/2012	C	979,19
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673168	CA.ESP.DUERO/PAG 20120723	23/07/2012	C	977,88
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673176	CA.ESP.DUERO/PAG 20120725	25/07/2012	C	977,71
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673184	CA.ESP.DUERO/PAG 20130121	21/01/2013	C	960,89
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673192	CA.ESP.DUERO/PAG 20130123	23/01/2013	C	958,60
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673200	CA.ESP.DUERO/PAG 20120410	10/04/2012	C	986,85
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673218	CA.ESP.DUERO/PAG 20130513	13/05/2013	C	950,51
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673226	CA.ESP.DUERO/PAG 20130515	15/05/2013	C	947,69
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673234	CA.ESP.DUERO/PAG 20120411	11/04/2012	C	986,75
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673242	CA.ESP.DUERO/PAG 20120724	24/07/2012	C	977,15
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673259	CA.ESP.DUERO/PAG 20120726	26/07/2012	C	978,00
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673267	CA.ESP.DUERO/PAG 20130122	22/01/2013	C	961,16
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673275	CA.ESP.DUERO/PAG 20130124	24/01/2013	C	958,89
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673283	CA.ESP.DUERO/PAG 20130514	14/05/2013	C	950,78
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0558673291	CA.ESP.DUERO/PAG 20130516	16/05/2013	C	947,97
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861I25	SAB/PAG 20120125	25/01/2012	C	996,12
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861JX8	SAB/PAG 20120111	11/01/2012	C	996,92
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861JZ3	SAB/PAG 20120113	13/01/2012	C	993,39
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861OD0	SAB/PAG 20120116	16/01/2012	C	993,20
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861PC9	SAB/PAG 20120830	30/08/2012	C	965,89
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861PG0	SAB/PAG 20120905	05/09/2012	C	974,29
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861QC7	SAB/PAG 20120322	22/03/2012	C	991,73
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861QF0	SAB/PAG 20120823	23/08/2012	C	968,79
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861RI2	SAB/PAG 20121030	30/10/2012	C	967,42
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861SP5	SAB/PAG 20121017	17/10/2012	C	963,23
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861UC9	SAB/PAG 20121105	05/11/2012	C	965,22
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861UO4	SAB/PAG 20121112	12/11/2012	C	963,56
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139806O5	BVA/PAG 20120125	25/01/2012	C	994,10
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139806W8	BVA/PAG 20120110	10/01/2012	C	996,14
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139806X6	BVA/PAG 20120210	10/02/2012	C	994,17
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139806Y4	BVA/PAG 20120227	27/02/2012	C	993,21
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139806Z1	BVA/PAG 20120312	12/03/2012	C	992,41
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139807B0	BVA/PAG 20121025	25/10/2012	C	968,48
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139807G9	BVA/PAG 20121126	26/11/2012	C	961,64
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139807J3	BVA/PAG 20121210	10/12/2012	C	960,92
BANCO GRUPO CAJATRES, S.A.	ES0535701017	CAJATRES/PAG 20121219	19/12/2012	C	48.464,92
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580CE9	GUI/PAG 20120201	01/02/2012	C	99.096,59
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580CY7	GUI/PAG 20120312	12/03/2012	C	98.598,82
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580DH0	GUI/PAG 20121011	11/10/2012	C	96.552,75
BANCO MARE NOSTRUM, S.A.	ES0513056061	MARE.NOSTRUM/PAG 20120123	23/01/2012	C	49.677,22
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES05138067H9	POP/PAG 20120105	05/01/2012	C	994,27
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES05138068T2	POP/PAG 20120224	24/02/2012	C	987,31
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES05138069N3	POP/PAG 20120323	23/03/2012	C	987,77
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806B31	POP/PAG 20121102	02/11/2012	C	966,12
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806D70	POP/PAG 20120601	01/06/2012	C	985,10
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806E12	POP/PAG 20121130	30/11/2012	C	960,74
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806G69	POP/PAG 20120507	07/05/2012	C	984,40
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806H43	POP/PAG 20130110	10/01/2013	C	958,07
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806H92	POP/PAG 20120210	10/02/2012	C	995,02
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806I91	POP/PAG 20130125	25/01/2013	C	956,60
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806K71	POP/PAG 20120907	07/09/2012	C	968,68
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806K97	POP/PAG 20120914	14/09/2012	C	966,75
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806L54	POP/PAG 20120921	21/09/2012	C	966,54
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806L70	POP/PAG 20120330	30/03/2012	C	993,26

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806M53	POP/PAG 20121005	05/10/2012	C	965,91
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806M87	POP/PAG 20130322	22/03/2013	C	954,06
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806N52	POP/PAG 20121011	11/10/2012	C	966,37
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806N60	POP/PAG 20121210	10/12/2012	C	961,64
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806O44	POP/PAG 20130412	12/04/2013	C	948,06
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806O85	POP/PAG 20121116	16/11/2012	C	964,27
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806O93	POP/PAG 20121019	19/10/2012	C	965,61
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806Q00	POP/PAG 20130426	26/04/2013	C	945,55
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806R41	POP/PAG 20121026	26/10/2012	C	964,88
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806S57	POP/PAG 20130517	17/05/2013	C	942,38
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806T98	POP/PAG 20121214	14/12/2012	C	963,24
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806U12	POP/PAG 20130614	14/06/2013	C	944,28
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806U46	POP/PAG 20121221	21/12/2012	C	961,97
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806U79	POP/PAG 20121228	28/12/2012	C	962,05
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900TK0	SAN/PAG 20121004	04/10/2012	C	971,50
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900TL8	SAN/PAG 20120105	05/01/2012	C	998,33
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900TM6	SAN/PAG 20120405	05/04/2012	C	989,51
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900TN4	SAN/PAG 20121009	09/10/2012	C	971,26
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900TO2	SAN/PAG 20130404	04/04/2013	C	950,80
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900TP9	SAN/PAG 20130409	09/04/2013	C	952,32
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900TQ7	SAN/PAG 20120119	19/01/2012	C	996,93
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900TS3	SAN/PAG 20121113	13/11/2012	C	966,36
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900TT1	SAN/PAG 20120503	03/05/2012	C	987,94
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900TU9	SAN/PAG 20121108	08/11/2012	C	966,66
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900TV7	SAN/PAG 20120202	02/02/2012	C	996,92
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900TW5	SAN/PAG 20130509	09/05/2013	C	946,96
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900TX3	SAN/PAG 20130514	14/05/2013	C	949,79
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900TY1	SAN/PAG 20130709	09/07/2013	C	939,89
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900TZ8	SAN/PAG 20130704	04/07/2013	C	939,06
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900UB7	SAN/PAG 20120216	16/02/2012	C	994,38
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900UC5	SAN/PAG 20120517	17/05/2012	C	986,37
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900UD3	SAN/PAG 20121213	13/12/2012	C	962,72
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900UE1	SAN/PAG 20120308	08/03/2012	C	993,04
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900UF8	SAN/PAG 20120607	07/06/2012	C	982,31
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900UG6	SAN/PAG 20121204	04/12/2012	C	964,15
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900UI2	SAN/PAG 20130103	03/01/2013	C	962,26
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0513900UM4	SAN/PAG 20130108	08/01/2013	C	961,14
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135404C8	BBE/PAG 20120112	12/01/2012	C	995,93
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135404G9	BBE/PAG 20120125	25/01/2012	C	996,79
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135404N5	BBE/PAG 20120228	28/02/2012	C	994,47
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135404U0	BBE/PAG 20120413	13/04/2012	C	987,56
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135405C5	BBE/PAG 20130704	04/07/2013	C	956,65
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135405P7	BBE/PAG 20120831	31/08/2012	C	969,71
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135405Q5	BBE/PAG 20120910	10/09/2012	C	969,63
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135405R3	BBE/PAG 20120913	13/09/2012	C	966,67
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135405S1	BBE/PAG 20120914	14/09/2012	C	966,69
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135405U7	BBE/PAG 20121022	22/10/2012	C	963,68
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135405V5	BBE/PAG 20130118	18/01/2013	C	958,65
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135406D1	BBE/PAG 20120521	21/05/2012	C	984,40
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135406I0	BBE/PAG 20121120	20/11/2012	C	963,06
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135406J8	BBE/PAG 20130220	20/02/2013	C	955,45
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135406Q3	BBE/PAG 20120210	10/02/2012	C	993,62
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135406S9	BBE/PAG 20121224	24/12/2012	C	963,78
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135406T7	BBE/PAG 20130325	25/03/2013	C	954,06
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135406U5	BBE/PAG 20120625	25/06/2012	C	982,78
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135406W1	BBE/PAG 20121228	28/12/2012	C	964,68
BANKIA, S.A.	ES0513307365	BKIA/PAG 20120120	20/01/2012	C	994,91
BANKIA, S.A.	ES0513307381	BKIA/PAG 20121022	22/10/2012	C	964,41
BANKIA, S.A.	ES0513307472	BKIA/PAG 20121029	29/10/2012	C	967,34
BANKIA, S.A.	ES0513307522	BKIA/PAG 20121105	05/11/2012	C	964,41
BANKIA, S.A.	ES0513307597	BKIA/PAG 20121112	12/11/2012	C	964,41
BANKIA, S.A.	ES0513307670	BKIA/PAG 20121119	19/11/2012	C	961,84
BANKIA, S.A.	ES0513307704	BKIA/PAG 20120521	21/05/2012	C	983,95
BANKIA, S.A.	ES0513307878	BKIA/PAG 20121217	17/12/2012	C	961,94
BANKIA, S.A.	ES0513307969	BKIA/PAG 20120326	26/03/2012	C	992,15
BANKINTER, S.A.	ES0513679Q59	BKT/PAG 20120127	27/01/2012	C	993,11
BANKINTER, S.A.	ES0513679QV3	BKT/PAG 20120227	27/02/2012	C	994,71
BANKINTER, S.A.	ES0513679QX9	BKT/PAG 20120103	03/01/2012	C	992,58
BANKINTER, S.A.	ES0513679RA5	BKT/PAG 20120322	22/03/2012	C	986,95
BANKINTER, S.A.	ES0513679RZ2	BKT/PAG 20120903	03/09/2012	C	968,42
BANKINTER, S.A.	ES0513679SC9	BKT/PAG 20121001	01/10/2012	C	967,26
BANKINTER, S.A.	ES0513679SE5	BKT/PAG 20121003	03/10/2012	C	967,39
BANKINTER, S.A.	ES0513679ST3	BKT/PAG 20120307	07/03/2012	C	993,31
BANKINTER, S.A.	ES0513679TC7	BKT/PAG 20120125	25/01/2012	C	997,97
BANKINTER, S.A.	ES0513679TQ7	BKT/PAG 20120516	16/05/2012	C	984,05
BANKINTER, S.A.	ES0513679TZ8	BKT/PAG 20121128	28/11/2012	C	963,77
BANKINTER, S.A.	ES0513679UA9	BKT/PAG 20121227	27/12/2012	C	961,54
BANKINTER, S.A.	ES0513679VA7	BKT/PAG 20121219	19/12/2012	C	963,96
BANKOA, S.A.	ES0513676Y80	BANKOA/PAG 20121008	08/10/2012	C	968,86
BANKOA, S.A.	ES0513676Z71	BANKOA/PAG 20121102	02/11/2012	C	971,16
BANKOA, S.A.	ES0513676Z97	BANKOA/PAG 20120302	02/03/2012	C	992,32
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134246A8	BBK.EMPTOS/PAG 20130313	13/03/2013	C	955,36
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687UT2	BBVAF/PAG 20121213	13/12/2012	C	964,68
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687VP8	BBVAF/PAG 20120125	25/01/2012	C	995,09
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687VT0	BBVAF/PAG 20120730	30/07/2012	C	979,76

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687VY0	BBVAF/PAG 20120227	27/02/2012	C	991,96
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687WL5	BBVAF/PAG 20121001	01/10/2012	C	966,81
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687WM3	BBVAF/PAG 20121024	24/10/2012	C	967,15
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687WN1	BBVAF/PAG 20121101	01/11/2012	C	966,72
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687WO9	BBVAF/PAG 20121122	22/11/2012	C	965,86
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687WP6	BBVAF/PAG 20121123	23/11/2012	C	965,36
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687WQ4	BBVAF/PAG 20121221	21/12/2012	C	965,17
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687WR2	BBVAF/PAG 20121224	24/12/2012	C	964,94
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687WS0	BBVAF/PAG 20130102	02/01/2013	C	962,32
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687WT8	BBVAF/PAG 20130308	08/03/2013	C	950,03
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687WU6	BBVAF/PAG 20130315	15/03/2013	C	959,27
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687WV4	BBVAF/PAG 20130319	19/03/2013	C	952,61
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XA6	BBVAF/PAG 20120102	02/01/2012	C	994,35
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XB4	BBVAF/PAG 20120110	10/01/2012	C	997,18
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XC2	BBVAF/PAG 20120116	16/01/2012	C	995,61
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XD0	BBVAF/PAG 20120117	17/01/2012	C	994,17
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XE8	BBVAF/PAG 20120123	23/01/2012	C	993,75
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XF5	BBVAF/PAG 20120124	24/01/2012	C	993,41
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XG3	BBVAF/PAG 20120126	26/01/2012	C	993,53
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XH1	BBVAF/PAG 20120301	01/03/2012	C	992,32
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XI9	BBVAF/PAG 20120302	02/03/2012	C	992,24
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XJ7	BBVAF/PAG 20120309	09/03/2012	C	992,22
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XK5	BBVAF/PAG 20120321	21/03/2012	C	992,32
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XL3	BBVAF/PAG 20120322	22/03/2012	C	992,41
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XM1	BBVAF/PAG 20120323	23/03/2012	C	992,36
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XN9	BBVAF/PAG 20120326	26/03/2012	C	991,17
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XO7	BBVAF/PAG 20120328	28/03/2012	C	991,78
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XP4	BBVAF/PAG 20120424	24/04/2012	C	987,70
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XQ2	BBVAF/PAG 20120430	30/04/2012	C	986,65
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XR0	BBVAF/PAG 20120522	22/05/2012	C	983,77
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XS8	BBVAF/PAG 20120524	24/05/2012	C	983,49
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XT6	BBVAF/PAG 20120622	22/06/2012	C	983,95
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XU4	BBVAF/PAG 20120625	25/06/2012	C	983,74
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XV2	BBVAF/PAG 20120626	26/06/2012	C	983,58
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XW0	BBVAF/PAG 20120629	29/06/2012	C	983,15
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XX8	BBVAF/PAG 20120724	24/07/2012	C	979,45
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XY6	BBVAF/PAG 20120801	01/08/2012	C	976,35
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687XZ3	BBVAF/PAG 20120822	22/08/2012	C	973,32
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YA4	BBVAF/PAG 20120823	23/08/2012	C	969,41
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YB2	BBVAF/PAG 20120917	17/09/2012	C	971,46
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YC0	BBVAF/PAG 20120920	20/09/2012	C	970,27
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YD8	BBVAF/PAG 20120921	21/09/2012	C	967,42
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YE6	BBVAF/PAG 20120924	24/09/2012	C	966,98
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YF3	BBVAF/PAG 20120925	25/09/2012	C	967,10
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YG1	BBVAF/PAG 20120926	26/09/2012	C	966,58
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YH9	BBVAF/PAG 20120927	27/09/2012	C	966,10
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YI7	BBVAF/PAG 20120928	28/09/2012	C	967,01
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YK3	BBVAF/PAG 20121002	02/10/2012	C	967,65
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YL1	BBVAF/PAG 20130222	22/02/2013	C	960,97
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YM9	BBVAF/PAG 20130318	18/03/2013	C	956,11
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YN7	BBVAF/PAG 20130320	20/03/2013	C	956,23
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YO5	BBVAF/PAG 20130321	21/03/2013	C	955,99
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YP2	BBVAF/PAG 20130322	22/03/2013	C	952,44
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YU2	BBVAF/PAG 20120103	03/01/2012	C	993,45
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YV0	BBVAF/PAG 20120104	04/01/2012	C	994,51
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YW8	BBVAF/PAG 20120109	09/01/2012	C	995,20
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YX6	BBVAF/PAG 20120111	11/01/2012	C	993,72
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YY4	BBVAF/PAG 20120228	28/02/2012	C	992,15
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687YZ1	BBVAF/PAG 20120229	29/02/2012	C	992,29
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZA1	BBVAF/PAG 20120313	13/03/2012	C	992,79
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZB9	BBVAF/PAG 20120315	15/03/2012	C	992,25
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZC7	BBVAF/PAG 20120327	27/03/2012	C	992,28
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZD5	BBVAF/PAG 20120329	29/03/2012	C	991,46
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZE3	BBVAF/PAG 20120330	30/03/2012	C	990,88
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZF0	BBVAF/PAG 20120402	02/04/2012	C	991,53
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZG8	BBVAF/PAG 20120510	10/05/2012	C	987,20
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZH6	BBVAF/PAG 20120525	25/05/2012	C	984,36
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZI4	BBVAF/PAG 20120528	28/05/2012	C	983,89
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZJ2	BBVAF/PAG 20120615	15/06/2012	C	984,05
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZK0	BBVAF/PAG 20120627	27/06/2012	C	983,31
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZL8	BBVAF/PAG 20120827	27/08/2012	C	970,76
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZM6	BBVAF/PAG 20120702	02/07/2012	C	981,32
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZN4	BBVAF/PAG 20120828	28/08/2012	C	973,11
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZO2	BBVAF/PAG 20120914	14/09/2012	C	970,19
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZP9	BBVAF/PAG 20121126	26/11/2012	C	965,10
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZQ7	BBVAF/PAG 20121227	27/12/2012	C	964,19
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZR5	BBVAF/PAG 20121231	31/12/2012	C	963,96
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZS3	BBVAF/PAG 20130103	03/01/2013	C	963,00
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZT1	BBVAF/PAG 20130128	28/01/2013	C	959,40
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZU9	BBVAF/PAG 20130301	01/03/2013	C	956,29
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZV7	BBVAF/PAG 20130304	04/03/2013	C	958,50
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZX3	BBVAF/PAG 20130305	05/03/2013	C	955,97
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZY1	BBVAF/PAG 20130326	26/03/2013	C	951,58
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687ZZ8	BBVAF/PAG 20130327	27/03/2013	C	954,82
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688012	BBVAF/PAG 20120105	05/01/2012	C	993,83

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688020	BBVAF/PAG 20120106	06/01/2012	C	993,91
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688038	BBVAF/PAG 20120130	30/01/2012	C	996,05
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688046	BBVAF/PAG 20120131	31/01/2012	C	992,55
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688053	BBVAF/PAG 20120404	04/04/2012	C	987,05
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688061	BBVAF/PAG 20120412	12/04/2012	C	989,73
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688079	BBVAF/PAG 20120426	26/04/2012	C	988,64
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688095	BBVAF/PAG 20120628	28/06/2012	C	983,37
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880A2	BBVAF/PAG 20130306	06/03/2013	C	955,61
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880B0	BBVAF/PAG 20130404	04/04/2013	C	952,05
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880E4	BBVAF/PAG 20120213	13/02/2012	C	993,70
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880F1	BBVAF/PAG 20120215	15/02/2012	C	991,53
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880G9	BBVAF/PAG 20120306	06/03/2012	C	992,12
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880H7	BBVAF/PAG 20120425	25/04/2012	C	987,44
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880I5	BBVAF/PAG 20120504	04/05/2012	C	986,99
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880J3	BBVAF/PAG 20120514	14/05/2012	C	987,47
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880K1	BBVAF/PAG 20120605	05/06/2012	C	983,72
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880L9	BBVAF/PAG 20120709	09/07/2012	C	982,01
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880M7	BBVAF/PAG 20120717	17/07/2012	C	981,58
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880N5	BBVAF/PAG 20130405	05/04/2013	C	952,99
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880P0	BBVAF/PAG 20120113	13/01/2012	C	994,39
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880Q8	BBVAF/PAG 20120214	14/02/2012	C	994,14
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880R6	BBVAF/PAG 20120221	21/02/2012	C	992,97
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880S4	BBVAF/PAG 20120417	17/04/2012	C	988,11
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880T2	BBVAF/PAG 20120503	03/05/2012	C	985,17
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880U0	BBVAF/PAG 20121011	11/10/2012	C	966,93
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880V8	BBVAF/PAG 20121022	22/10/2012	C	967,34
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880W6	BBVAF/PAG 20121105	05/11/2012	C	967,22
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880X4	BBVAF/PAG 20121106	06/11/2012	C	967,11
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880Y2	BBVAF/PAG 20121115	15/11/2012	C	968,59
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136880Z9	BBVAF/PAG 20121206	06/12/2012	C	964,16
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688103	BBVAF/PAG 20120824	24/08/2012	C	972,53
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688111	BBVAF/PAG 20130110	10/01/2013	C	960,94
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688129	BBVAF/PAG 20121003	03/10/2012	C	966,71
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688137	BBVAF/PAG 20121004	04/10/2012	C	966,87
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688145	BBVAF/PAG 20121005	05/10/2012	C	966,71
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688152	BBVAF/PAG 20121116	16/11/2012	C	968,61
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688160	BBVAF/PAG 20121217	17/12/2012	C	964,64
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688178	BBVAF/PAG 20120127	27/01/2012	C	992,74
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688186	BBVAF/PAG 20120201	01/02/2012	C	992,59
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688194	BBVAF/PAG 20120203	03/02/2012	C	992,99
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881A0	BBVAF/PAG 20130108	08/01/2013	C	963,07
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881B8	BBVAF/PAG 20130115	15/01/2013	C	960,90
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881C6	BBVAF/PAG 20130131	31/01/2013	C	961,11
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881D4	BBVAF/PAG 20130205	05/02/2013	C	959,63
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881E2	BBVAF/PAG 20130206	06/02/2013	C	966,33
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881F9	BBVAF/PAG 20130311	11/03/2013	C	956,16
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881G7	BBVAF/PAG 20120222	22/02/2012	C	992,02
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881H5	BBVAF/PAG 20120515	15/05/2012	C	987,24
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881I3	BBVAF/PAG 20120608	08/06/2012	C	984,11
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881J1	BBVAF/PAG 20120620	20/06/2012	C	983,91
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881K9	BBVAF/PAG 20120810	10/08/2012	C	977,86
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881L7	BBVAF/PAG 20120910	10/09/2012	C	970,65
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881M5	BBVAF/PAG 20120912	12/09/2012	C	968,97
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881N3	BBVAF/PAG 20121012	12/10/2012	C	965,92
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881O1	BBVAF/PAG 20130109	09/01/2013	C	963,37
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881P8	BBVAF/PAG 20130207	07/02/2013	C	962,94
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881Q6	BBVAF/PAG 20130208	08/02/2013	C	960,43
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881R4	BBVAF/PAG 20120208	08/02/2012	C	993,78
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881S2	BBVAF/PAG 20120210	10/02/2012	C	992,86
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881T0	BBVAF/PAG 20130114	14/01/2013	C	961,26
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881U8	BBVAF/PAG 20130121	21/01/2013	C	962,46
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881V6	BBVAF/PAG 20130314	14/03/2013	C	958,66
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881W4	BBVAF/PAG 20120423	23/04/2012	C	988,71
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881X2	BBVAF/PAG 20120607	07/06/2012	C	983,06
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136881Y0	BBVAF/PAG 20120611	11/06/2012	C	983,23
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688202	BBVAF/PAG 20120410	10/04/2012	C	987,96
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688210	BBVAF/PAG 20120531	31/05/2012	C	983,97
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688228	BBVAF/PAG 20130111	11/01/2013	C	960,80
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688236	BBVAF/PAG 20130228	28/02/2013	C	957,12
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688244	BBVAF/PAG 20130307	07/03/2013	C	955,40
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688251	BBVAF/PAG 20130325	25/03/2013	C	958,91
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688269	BBVAF/PAG 20130328	28/03/2013	C	951,71
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688293	BBVAF/PAG 20130201	01/02/2013	C	963,44
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882A8	BBVAF/PAG 20121017	17/10/2012	C	967,32
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882B6	BBVAF/PAG 20121018	18/10/2012	C	967,23
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882C4	BBVAF/PAG 20121019	19/10/2012	C	967,18
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882G5	BBVAF/PAG 20120209	09/02/2012	C	993,81
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882H3	BBVAF/PAG 20120216	16/02/2012	C	991,68
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882I1	BBVAF/PAG 20130410	10/04/2013	C	952,22
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882J9	BBVAF/PAG 20120711	11/07/2012	C	982,37
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882K7	BBVAF/PAG 20120712	12/07/2012	C	981,37
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882M3	BBVAF/PAG 20121025	25/10/2012	C	965,92
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882N1	BBVAF/PAG 20121026	26/10/2012	C	966,58
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882O9	BBVAF/PAG 20121112	12/11/2012	C	967,74
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882P6	BBVAF/PAG 20130116	16/01/2013	C	964,90

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882O4	BBVAF/PAG 20130125	25/01/2013	C	963,01
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882R2	BBVAF/PAG 20130211	11/02/2013	C	961,26
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882S0	BBVAF/PAG 20130312	12/03/2013	C	958,97
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882T8	BBVAF/PAG 20121113	13/11/2012	C	967,55
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882U6	BBVAF/PAG 20121128	28/11/2012	C	963,68
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882V4	BBVAF/PAG 20130117	17/01/2013	C	959,35
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882W2	BBVAF/PAG 20130411	11/04/2013	C	955,31
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882X0	BBVAF/PAG 20120614	14/06/2012	C	983,41
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882Y8	BBVAF/PAG 20120713	13/07/2012	C	981,72
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136882Z5	BBVAF/PAG 20120913	13/09/2012	C	969,47
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688301	BBVAF/PAG 20120918	18/09/2012	C	970,12
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688319	BBVAF/PAG 20121008	08/10/2012	C	967,19
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688327	BBVAF/PAG 20121130	30/11/2012	C	964,43
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688335	BBVAF/PAG 20121220	20/12/2012	C	965,06
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688343	BBVAF/PAG 20121228	28/12/2012	C	964,36
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688368	BBVAF/PAG 20120202	02/02/2012	C	993,15
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688376	BBVAF/PAG 20120220	20/02/2012	C	991,28
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688384	BBVAF/PAG 20120305	05/03/2012	C	992,23
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688392	BBVAF/PAG 20120403	03/04/2012	C	986,58
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883A6	BBVAF/PAG 20120720	20/07/2012	C	978,15
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883E8	BBVAF/PAG 20120314	14/03/2012	C	992,32
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883F5	BBVAF/PAG 20120613	13/06/2012	C	983,75
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883G3	BBVAF/PAG 20120716	16/07/2012	C	980,71
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883H1	BBVAF/PAG 20121114	14/11/2012	C	967,49
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883I9	BBVAF/PAG 20130313	13/03/2013	C	955,08
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883J7	BBVAF/PAG 20130408	08/04/2013	C	950,87
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883K5	BBVAF/PAG 20130412	12/04/2013	C	952,03
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883M1	BBVAF/PAG 20120919	19/09/2012	C	973,15
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883N9	BBVAF/PAG 20130213	13/02/2013	C	959,01
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883O7	BBVAF/PAG 20130409	09/04/2013	C	954,47
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883P4	BBVAF/PAG 20120118	18/01/2012	C	994,00
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883Q2	BBVAF/PAG 20120418	18/04/2012	C	986,84
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883R0	BBVAF/PAG 20120507	07/05/2012	C	987,67
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883S8	BBVAF/PAG 20120621	21/06/2012	C	983,28
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883T6	BBVAF/PAG 20121210	10/12/2012	C	964,94
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883U4	BBVAF/PAG 20130124	24/01/2013	C	960,75
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883V2	BBVAF/PAG 20120119	19/01/2012	C	995,15
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883W0	BBVAF/PAG 20120217	17/02/2012	C	993,30
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883X8	BBVAF/PAG 20120419	19/04/2012	C	988,89
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883Y6	BBVAF/PAG 20120618	18/06/2012	C	983,61
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136883Z3	BBVAF/PAG 20120619	19/06/2012	C	983,32
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688400	BBVAF/PAG 20120710	10/07/2012	C	980,84
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688418	BBVAF/PAG 20120723	23/07/2012	C	980,52
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688426	BBVAF/PAG 20120815	15/08/2012	C	976,11
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688434	BBVAF/PAG 20120829	29/08/2012	C	970,97
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688442	BBVAF/PAG 20120911	11/09/2012	C	968,77
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688459	BBVAF/PAG 20120530	30/05/2012	C	983,92
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688467	BBVAF/PAG 20120601	01/06/2012	C	982,76
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688475	BBVAF/PAG 20120604	04/06/2012	C	983,65
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688483	BBVAF/PAG 20120806	06/08/2012	C	970,87
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688491	BBVAF/PAG 20120907	07/09/2012	C	973,17
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884A4	BBVAF/PAG 20130215	15/02/2013	C	963,24
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884B2	BBVAF/PAG 20130218	18/02/2013	C	963,57
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884C0	BBVAF/PAG 20130415	15/04/2013	C	956,22
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884D8	BBVAF/PAG 20130417	17/04/2013	C	952,74
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884E6	BBVAF/PAG 20120223	23/02/2012	C	992,34
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884F3	BBVAF/PAG 20120316	16/03/2012	C	992,52
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884G1	BBVAF/PAG 20121023	23/10/2012	C	966,67
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884H9	BBVAF/PAG 20121119	19/11/2012	C	968,12
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884I7	BBVAF/PAG 20121120	20/11/2012	C	967,94
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884J5	BBVAF/PAG 20121121	21/11/2012	C	967,96
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884K3	BBVAF/PAG 20120517	17/05/2012	C	987,99
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884L1	BBVAF/PAG 20121207	07/12/2012	C	964,34
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884M9	BBVAF/PAG 20130418	18/04/2013	C	951,76
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884P2	BBVAF/PAG 20120511	11/05/2012	C	987,62
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884Q0	BBVAF/PAG 20120521	21/05/2012	C	985,97
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884S6	BBVAF/PAG 20120727	27/07/2012	C	981,23
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884T4	BBVAF/PAG 20130122	22/01/2013	C	962,87
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884U2	BBVAF/PAG 20130219	19/02/2013	C	964,68
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884V0	BBVAF/PAG 20130419	19/04/2013	C	952,42
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884X6	BBVAF/PAG 20120509	09/05/2012	C	987,44
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136884Z1	BBVAF/PAG 20120813	13/08/2012	C	978,27
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688509	BBVAF/PAG 20121029	29/10/2012	C	967,06
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688517	BBVAF/PAG 20121031	31/10/2012	C	966,56
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688525	BBVAF/PAG 20121102	02/11/2012	C	967,36
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688533	BBVAF/PAG 20121203	03/12/2012	C	965,24
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688541	BBVAF/PAG 20121211	11/12/2012	C	965,65
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688558	BBVAF/PAG 20120224	24/02/2012	C	992,43
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688566	BBVAF/PAG 20120320	20/03/2012	C	992,13
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688574	BBVAF/PAG 20120405	05/04/2012	C	988,26
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688582	BBVAF/PAG 20120416	16/04/2012	C	988,46
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688590	BBVAF/PAG 20120427	27/04/2012	C	987,67
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885A1	BBVAF/PAG 20130220	20/02/2013	C	964,83
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885C7	BBVAF/PAG 20120726	26/07/2012	C	979,25
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885D5	BBVAF/PAG 20121107	07/11/2012	C	967,74

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885F0	BBVAF/PAG 20130123	23/01/2013	C	960,60
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885H6	BBVAF/PAG 20130422	22/04/2013	C	950,29
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885J2	BBVAF/PAG 20130424	24/04/2013	C	951,31
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885K0	BBVAF/PAG 20120817	17/08/2012	C	979,34
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885L8	BBVAF/PAG 20121108	08/11/2012	C	967,77
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885M6	BBVAF/PAG 20130425	25/04/2013	C	952,09
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885N4	BBVAF/PAG 20121205	05/12/2012	C	964,98
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885P9	BBVAF/PAG 20130426	26/04/2013	C	951,41
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885Q7	BBVAF/PAG 20120518	18/05/2012	C	986,90
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885R5	BBVAF/PAG 20130129	29/01/2013	C	967,97
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885T1	BBVAF/PAG 20130130	30/01/2013	C	962,44
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885U9	BBVAF/PAG 20120802	02/08/2012	C	981,84
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885V7	BBVAF/PAG 20121109	09/11/2012	C	968,08
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885X3	BBVAF/PAG 20130430	30/04/2013	C	951,01
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885Y1	BBVAF/PAG 20130502	02/05/2013	C	951,51
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136885Z8	BBVAF/PAG 20130503	03/05/2013	C	953,62
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688608	BBVAF/PAG 20120420	20/04/2012	C	987,49
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688616	BBVAF/PAG 20120502	02/05/2012	C	986,72
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688624	BBVAF/PAG 20120831	31/08/2012	C	972,46
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688632	BBVAF/PAG 20120903	03/09/2012	C	970,57
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688640	BBVAF/PAG 20120904	04/09/2012	C	970,93
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688657	BBVAF/PAG 20120905	05/09/2012	C	971,93
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688665	BBVAF/PAG 20121010	10/10/2012	C	967,29
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688673	BBVAF/PAG 20121030	30/10/2012	C	966,85
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688681	BBVAF/PAG 20121214	14/12/2012	C	965,27
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688699	BBVAF/PAG 20130118	18/01/2013	C	963,23
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886A9	BBVAF/PAG 20130429	29/04/2013	C	949,41
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886B7	BBVAF/PAG 20120523	23/05/2012	C	983,72
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886D3	BBVAF/PAG 20120508	08/05/2012	C	987,52
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886E1	BBVAF/PAG 20120516	16/05/2012	C	987,89
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886G6	BBVAF/PAG 20120308	08/03/2012	C	992,50
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886I2	BBVAF/PAG 20130506	06/05/2013	C	951,68
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886J0	BBVAF/PAG 20130507	07/05/2013	C	950,84
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886K8	BBVAF/PAG 20130508	08/05/2013	C	954,35
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886M4	BBVAF/PAG 20130212	12/02/2013	C	963,55
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886N2	BBVAF/PAG 20130509	09/05/2013	C	955,03
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886O0	BBVAF/PAG 20120808	08/08/2012	C	978,45
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886P7	BBVAF/PAG 20120820	20/08/2012	C	978,46
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886Q5	BBVAF/PAG 20130510	10/05/2013	C	954,17
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886R3	BBVAF/PAG 20130214	14/02/2013	C	959,18
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886S1	BBVAF/PAG 20121127	27/11/2012	C	965,15
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886T9	BBVAF/PAG 20120830	30/08/2012	C	974,65
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886W3	BBVAF/PAG 20120821	21/08/2012	C	974,27
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886X1	BBVAF/PAG 20130514	14/05/2013	C	950,27
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886Y9	BBVAF/PAG 20130515	15/05/2013	C	952,36
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136886Z6	BBVAF/PAG 20120529	29/05/2012	C	983,68
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688707	BBVAF/PAG 20130204	04/02/2013	C	963,79
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688756	BBVAF/PAG 20120112	12/01/2012	C	993,37
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688764	BBVAF/PAG 20120120	20/01/2012	C	993,84
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688772	BBVAF/PAG 20120206	06/02/2012	C	991,88
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688780	BBVAF/PAG 20120703	03/07/2012	C	982,15
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688798	BBVAF/PAG 20120704	04/07/2012	C	981,20
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887A7	BBVAF/PAG 20120816	16/08/2012	C	977,21
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887B5	BBVAF/PAG 20130227	27/02/2013	C	968,84
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887C3	BBVAF/PAG 20130416	16/04/2013	C	960,42
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887D1	BBVAF/PAG 20130516	16/05/2013	C	955,36
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887E9	BBVAF/PAG 20121129	29/11/2012	C	965,38
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887F6	BBVAF/PAG 20130517	17/05/2013	C	953,32
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887G4	BBVAF/PAG 20121218	18/12/2012	C	965,29
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887H2	BBVAF/PAG 20130225	25/02/2013	C	960,89
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887I0	BBVAF/PAG 20121212	12/12/2012	C	964,72
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887J8	BBVAF/PAG 20130221	21/02/2013	C	963,04
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887K6	BBVAF/PAG 20130520	20/05/2013	C	953,79
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887L4	BBVAF/PAG 20130522	22/05/2013	C	949,24
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887M2	BBVAF/PAG 20130521	21/05/2013	C	954,97
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887N0	BBVAF/PAG 20130523	23/05/2013	C	947,07
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887O8	BBVAF/PAG 20121219	19/12/2012	C	964,71
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887P5	BBVAF/PAG 20130524	24/05/2013	C	948,00
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887R1	BBVAF/PAG 20130528	28/05/2013	C	947,23
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887S9	BBVAF/PAG 20130529	29/05/2013	C	948,03
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887T7	BBVAF/PAG 20130527	27/05/2013	C	948,83
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887U5	BBVAF/PAG 20130530	30/05/2013	C	948,20
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887V3	BBVAF/PAG 20130531	31/05/2013	C	947,30
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887W1	BBVAF/PAG 20130605	05/06/2013	C	946,74
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887X9	BBVAF/PAG 20130603	03/06/2013	C	946,85
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887Y7	BBVAF/PAG 20130604	04/06/2013	C	944,57
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136887Z4	BBVAF/PAG 20130606	06/06/2013	C	951,19
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688806	BBVAF/PAG 20120705	05/07/2012	C	983,65
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688814	BBVAF/PAG 20120706	06/07/2012	C	982,90
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688830	BBVAF/PAG 20120731	31/07/2012	C	978,87
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688848	BBVAF/PAG 20120906	06/09/2012	C	970,77
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688855	BBVAF/PAG 20121015	15/10/2012	C	966,76
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688863	BBVAF/PAG 20121016	16/10/2012	C	967,25
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688871	BBVAF/PAG 20121204	04/12/2012	C	965,73
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688889	BBVAF/PAG 20130104	04/01/2013	C	962,55

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688897	BBVAF/PAG 20130402	02/04/2013	C	949,08
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136888B3	BBVAF/PAG 20130607	07/06/2013	C	948,11
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136888C1	BBVAF/PAG 20120612	12/06/2012	C	984,37
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136888D9	BBVAF/PAG 20130612	12/06/2013	C	947,04
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136888E7	BBVAF/PAG 20130513	13/05/2013	C	949,61
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136888F4	BBVAF/PAG 20130613	13/06/2013	C	947,04
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136888H0	BBVAF/PAG 20130614	14/06/2013	C	948,22
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136888I8	BBVAF/PAG 20130611	11/06/2013	C	947,86
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136888J6	BBVAF/PAG 20130619	19/06/2013	C	944,68
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136888K4	BBVAF/PAG 20130620	20/06/2013	C	947,87
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136888L2	BBVAF/PAG 20130621	21/06/2013	C	947,23
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136888M0	BBVAF/PAG 20130617	17/06/2013	C	947,41
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136888N8	BBVAF/PAG 20130626	26/06/2013	C	945,24
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES05136888O6	BBVAF/PAG 20130627	27/06/2013	C	949,91
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688905	BBVAF/PAG 20130403	03/04/2013	C	951,33
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688913	BBVAF/PAG 20120207	07/02/2012	C	993,74
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688921	BBVAF/PAG 20120307	07/03/2012	C	992,36
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688939	BBVAF/PAG 20120312	12/03/2012	C	992,01
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688947	BBVAF/PAG 20120319	19/03/2012	C	992,17
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688954	BBVAF/PAG 20120411	11/04/2012	C	987,68
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688962	BBVAF/PAG 20120413	13/04/2012	C	988,57
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688970	BBVAF/PAG 20120606	06/06/2012	C	984,56
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688988	BBVAF/PAG 20121009	09/10/2012	C	968,29
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513688996	BBVAF/PAG 20130107	07/01/2013	C	961,90
CAIXABANK, S.A.	ES05406090D5	CABK/PAG 20121120	20/11/2012	C	964,85
CAIXABANK, S.A.	ES05406090F0	CABK/PAG 20121127	27/11/2012	C	966,24
CAIXABANK, S.A.	ES05406090G8	CABK/PAG 20121204	04/12/2012	C	966,09
CAIXABANK, S.A.	ES05406090O2	CABK/PAG 20120313	13/03/2012	C	992,89
CAIXABANK, S.A.	ES05406090P9	CABK/PAG 20130611	11/06/2013	C	948,76
CAIXABANK, S.A.	ES05406090Q7	CABK/PAG 20121211	11/12/2012	C	966,52
CAIXABANK, S.A.	ES05406090S3	CABK/PAG 20120626	26/06/2012	C	983,81
CAIXABANK, S.A.	ES05406090T1	CABK/PAG 20121227	27/12/2012	C	963,95
CAIXABANK, S.A.	ES05406090Y1	CABK/PAG 20130618	18/06/2013	C	947,09
CAIXABANK, S.A.	ES0540609197	CABK/PAG 20121218	18/12/2012	C	964,83
CAIXABANK, S.A.	ES0540609585	CABK/PAG 20120228	28/02/2012	C	993,61
CAIXABANK, S.A.	ES0540609809	CABK/PAG 20121009	09/10/2012	C	970,32
CAIXABANK, S.A.	ES0540609841	CABK/PAG 20121016	16/10/2012	C	967,98
CAIXABANK, S.A.	ES0540609957	CABK/PAG 20120320	20/03/2012	C	993,00
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306K55	CR.NAVARRA/PAG 20120704	04/07/2012	C	48.934,18
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306L39	CR.NAVARRA/PAG 20120229	29/02/2012	C	49.589,36
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306M04	CR.NAVARRA/PAG 20120118	18/01/2012	C	49.858,35
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306M20	CR.NAVARRA/PAG 20121017	17/10/2012	C	48.322,61
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306M38	CR.NAVARRA/PAG 20121024	24/10/2012	C	48.275,02
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306M46	CR.NAVARRA/PAG 20120125	25/01/2012	C	49.862,50
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306N52	CR.NAVARRA/PAG 20121107	07/11/2012	C	48.357,95
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306N60	CR.NAVARRA/PAG 20120516	16/05/2012	C	49.174,81
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306N78	CR.NAVARRA/PAG 20120613	13/06/2012	C	49.202,45
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306N86	CR.NAVARRA/PAG 20120523	23/05/2012	C	49.152,89
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306N94	CR.NAVARRA/PAG 20121114	14/11/2012	C	48.395,69
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306O02	CR.NAVARRA/PAG 20120222	22/02/2012	C	49.615,10
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306O10	CR.NAVARRA/PAG 20120620	20/06/2012	C	49.047,83
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306O28	CR.NAVARRA/PAG 20121121	21/11/2012	C	48.198,94
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306O36	CR.NAVARRA/PAG 20120530	30/05/2012	C	49.135,09
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306O44	CR.NAVARRA/PAG 20120606	06/06/2012	C	49.127,81
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306O51	CR.NAVARRA/PAG 20121128	28/11/2012	C	48.199,37
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306O69	CR.NAVARRA/PAG 20120328	28/03/2012	C	49.445,26
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306O77	CR.NAVARRA/PAG 20121205	05/12/2012	C	48.122,49
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306O85	CR.NAVARRA/PAG 20121212	12/12/2012	C	48.143,83
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306P01	CR.NAVARRA/PAG 20121219	19/12/2012	C	48.135,66
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306P27	CR.NAVARRA/PAG 20120627	27/06/2012	C	49.142,37
CAJA RURAL DE NAVARRA, SOCIEDAD COOPERATIVA D	ES0515306P35	CR.NAVARRA/PAG 20121227	27/12/2012	C	48.094,31
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0516932094	CATALUNYA.BANC/PAG 20121115	15/11/2012	C	965,49
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0516932128	CATALUNYA.BANC/PAG 20120524	24/05/2012	C	986,76
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0516932136	CATALUNYA.BANC/PAG 20121122	22/11/2012	C	969,12
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0516932144	CATALUNYA.BANC/PAG 20130122	22/01/2013	C	960,11
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0516932169	CATALUNYA.BANC/PAG 20130516	16/05/2013	C	943,09
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0516932193	CATALUNYA.BANC/PAG 20120529	29/05/2012	C	984,92
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0516932201	CATALUNYA.BANC/PAG 20130523	23/05/2013	C	947,66
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0516932227	CATALUNYA.BANC/PAG 20130129	29/01/2013	C	956,38
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0516932235	CATALUNYA.BANC/PAG 20130527	27/05/2013	C	942,38
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0516932243	CATALUNYA.BANC/PAG 20121213	13/12/2012	C	961,64
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0516932284	CATALUNYA.BANC/PAG 20130604	04/06/2013	C	948,34
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0516932292	CATALUNYA.BANC/PAG 20121220	20/12/2012	C	967,09
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0516932334	CATALUNYA.BANC/PAG 20130613	13/06/2013	C	942,35
CATALUNYA BANC, S.A.	ES0516932359	CATALUNYA.BANC/PAG 20120621	21/06/2012	C	984,90
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870526	GAS/PAG 20120425	25/04/2012	C	990,56
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060255A7	HIDROCANTABRICO/PAG 20120404	04/04/2012	C	990,30
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES05149543K0	IBERCAJA/PAG 20120119	19/01/2012	C	996,72
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES05149544K8	IBERCAJA/PAG 20120301	01/03/2012	C	988,07
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0544251087	IBERCAJA.BCO/PAG 20130131	31/01/2013	C	957,17
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0544251111	IBERCAJA.BCO/PAG 20120419	19/04/2012	C	988,67
KUTXABANK, S.A.U.	ES05153085G3	CA.VITAL/PAG 20120120	20/01/2012	C	49.520,99
KUTXABANK, S.A.U.	ES05153086Q0	CA.VITAL/PAG 20120903	03/09/2012	C	48.314,82
KUTXABANK, S.A.U.	ES05153086R8	CA.VITAL/PAG 20120914	14/09/2012	C	48.318,52
KUTXABANK, S.A.U.	ES05153086T4	CA.VITAL/PAG 20120921	21/09/2012	C	48.293,64

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
KUTXABANK, S.A.U.	ES05153086U2	CA.VITAL/PAG 20120928	28/09/2012	C	48.288,99
KUTXABANK, S.A.U.	ES05153086V0	CA.VITAL/PAG 20121002	02/10/2012	C	48.283,52
KUTXABANK, S.A.U.	ES05153086Y4	CA.VITAL/PAG 20120105	05/01/2012	C	49.824,15
LIBERBANK, S.A.	ES05148265K1	CAJASTUR/PAG 20120727	27/07/2012	C	48.498,51
LIBERBANK, S.A.	ES0568675039	LIBERBANK/PAG 20120907	07/09/2012	C	9.686,44
LIBERBANK, S.A.	ES0568675047	LIBERBANK/PAG 20120727	27/07/2012	C	9.703,52
LIBERBANK, S.A.	ES0568675054	LIBERBANK/PAG 20130125	25/01/2013	C	9.528,97
LIBERBANK, S.A.	ES0568675088	LIBERBANK/PAG 20120323	23/03/2012	C	9.880,13
LIBERBANK, S.A.	ES0568675096	LIBERBANK/PAG 20120927	27/09/2012	C	9.673,60
LIBERBANK, S.A.	ES0568675104	LIBERBANK/PAG 20130322	22/03/2013	C	9.519,85
LIBERBANK, S.A.	ES0568675112	LIBERBANK/PAG 20130927	27/09/2013	C	9.367,19
LIBERBANK, S.A.	ES0568675161	LIBERBANK/PAG 20130426	26/04/2013	C	9.504,94
LIBERBANK, S.A.	ES0568675179	LIBERBANK/PAG 20120427	27/04/2012	C	9.864,54
LIBERBANK, S.A.	ES0568675187	LIBERBANK/PAG 20121026	26/10/2012	C	9.671,81
LIBERBANK, S.A.	ES0568675195	LIBERBANK/PAG 20131025	25/10/2013	C	9.336,25
LIBERBANK, S.A.	ES0568675203	LIBERBANK/PAG 20120127	27/01/2012	C	9.942,57
LIBERBANK, S.A.	ES0568675237	LIBERBANK/PAG 20121123	23/11/2012	C	9.648,85
LIBERBANK, S.A.	ES0568675245	LIBERBANK/PAG 20120224	24/02/2012	C	9.942,58
LIBERBANK, S.A.	ES0568675252	LIBERBANK/PAG 20120525	25/05/2012	C	9.842,94
LIBERBANK, S.A.	ES0568675260	LIBERBANK/PAG 20130524	24/05/2013	C	9.440,74
LIBERBANK, S.A.	ES0568675278	LIBERBANK/PAG 20131122	22/11/2013	C	9.237,52
LIBERBANK, S.A.	ES0568675286	LIBERBANK/PAG 20131220	20/12/2013	C	9.249,71
LIBERBANK, S.A.	ES0568675294	LIBERBANK/PAG 20121221	21/12/2012	C	9.611,31
LIBERBANK, S.A.	ES0568675302	LIBERBANK/PAG 20130621	21/06/2013	C	9.437,14
LIBERBANK, S.A.	ES0568675310	LIBERBANK/PAG 20120622	22/06/2012	C	9.826,78
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0573093R96	REE/PAG 20120116	16/01/2012	C	995,42
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0573093S04	REE/PAG 20120430	30/04/2012	C	990,41
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495ET4	SAN.CONS.FIN/PAG 20120518	18/05/2012	C	986,49
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495EW8	SAN.CONS.FIN/PAG 20120727	27/07/2012	C	977,71
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495EZ1	SAN.CONS.FIN/PAG 20120824	24/08/2012	C	976,79
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495FG8	SAN.CONS.FIN/PAG 20120914	14/09/2012	C	974,92
TELEFONICA, S.A.	ES0578430I1L	TEF/PAG 20120116	16/01/2012	C	995,31
TELEFONICA, S.A.	ES0578430JB0	TEF/PAG 20120308	08/03/2012	C	99,034,10
TELEFONICA, S.A.	ES0578430JC8	TEF/PAG 20120315	15/03/2012	C	990,42
TELEFONICA, S.A.	ES0578430JD6	TEF/PAG 20120330	30/03/2012	C	990,30
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759280	UNICAJA/PAG 20120120	20/01/2012	C	49.836,27
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759355	UNICAJA/PAG 20120420	20/04/2012	C	49.331,21
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759470	UNICAJA/PAG 20121019	19/10/2012	C	48.412,46
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759488	UNICAJA/PAG 20121105	05/11/2012	C	48.471,07
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759496	UNICAJA/PAG 20120221	21/02/2012	C	994,07
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759512	UNICAJA/PAG 20120228	28/02/2012	C	991,87
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759520	UNICAJA/PAG 20120307	07/03/2012	C	991,46
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759538	UNICAJA/PAG 20120528	28/05/2012	C	982,81
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759546	UNICAJA/PAG 20120607	07/06/2012	C	982,96
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759553	UNICAJA/PAG 20121121	21/11/2012	C	966,08
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759561	UNICAJA/PAG 20120314	14/03/2012	C	991,24
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759579	UNICAJA/PAG 20120321	21/03/2012	C	991,36
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759587	UNICAJA/PAG 20120328	28/03/2012	C	991,13
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759595	UNICAJA/PAG 20120405	05/04/2012	C	990,69
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759603	UNICAJA/PAG 20120413	13/04/2012	C	990,29
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759611	UNICAJA/PAG 20120420	20/04/2012	C	989,97
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759629	UNICAJA/PAG 20120427	27/04/2012	C	988,68
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759652	UNICAJA/PAG 20120521	21/05/2012	C	983,43
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759660	UNICAJA/PAG 20120614	14/06/2012	C	982,95
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759678	UNICAJA/PAG 20120621	21/06/2012	C	982,80
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759686	UNICAJA/PAG 20120628	28/06/2012	C	982,49
UNICAJA BANCO, S.A.	ES0558759769	UNICAJA/PAG 20121128	28/11/2012	C	964,86

PARTICIPACIONES PREFERENTES

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCA CIVICA, S.A.	ES0114965009	CAN/VAR NACU AMTB PPR		V	1.000,00
BANCA CIVICA, S.A.	ES0115009005	CAJACANARIAS/VAR NACU AMTB PPR		V	1.009,71
BANCA CIVICA, S.A.	ES0848873008	BCA.CIVICA/VAR NACU AMTB PPR		V	1.006,58
BANCAJA EUROCAPITAL FINANCE, S.A.	KYG0727Q1073	BANCAJA.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	599,28
BANCAJA EUROCAPITAL FINANCE, S.A.	KYG0727Q1156	BANCAJA.FIN/VAR NACU AMTB PPR B		V	599,98
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0114854005	CAJADUERO/VAR NACU AMTB PPR		V	100,56
BANCO DE CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SALAMANC	ES0115474001	CA.ESPAÑA/VAR NACU AMTB PPR I		V	1.011,97
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0113860003	SAB/VAR NACU AMTB PPR		V	1.003,61
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0113440004	BTO/VAR NACU AMTB PPR 1		V	1.002,51
BANCO FINANCIERO Y DE AHORROS, S.A.	ES0114959002	CA.SEGOVIA/VAR NACU AMTB PPR		V	1.002,84
BANKINTER EMISIONES, S.A.U.	ES0113549002	BKT.EM/VAR NACU AMTB PPR I		V	34,75
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224001	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	100,38
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224027	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR B		V	100,42
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224043	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR C		V	100,41
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224050	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR D		V	100,42
BBVA INTERNATIONAL LIMITED	KYG090001119	BBVA.INTL/VAR NACU AMTB PPR F		V	100,38
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL LTD.	KYG1280W1015	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.000,04
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL LTD.	KYG717151099	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.000,00
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL LTD.	KYG717151172	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.000,00
BVA PREFERENTES, S.A.U.	ES0115006001	BVA.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	19.930,89
CAIXA CATALUNYA PREFERENTS, S.A.U.	KYG175431025	CA.CAT.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.002,19
CAIXA CATALUNYA PREFERENTS, S.A.U.	KYG175431108	CA.CAT.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.002,33
CAIXA DE MANLLEU PREFERENTS, S.A.	ES0115328009	CA.MANLLEU.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	500,62
CAIXA GALICIA PREFERENTES, S.A.	ES0112805009	CA.GALICIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	458,94
CAIXA GALICIA PREFERENTES, S.A.	ES0112805025	CA.GALICIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR D		V	900,07
CAIXA GALICIA PREFERENTES, S.A.	ES0112805041	CA.GALICIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR E		V	917,26
CAIXA LAIETANA, SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFI	ES0113251005	LAIETANA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	43.558,93
CAIXA LAIETANA, SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFI	ES0113251021	LAIETANA.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.010,26
CAIXA LAIETANA, SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFI	KYG1754W1087	LAIETANA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.005,29
CAIXA MANRESA PREFERENTS, S.A.	ES0115211007	CA.MANRESA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	100,07
CAIXA PENEDES CAPITAL, S.A.	ES0158672008	CA.PENEDES.CAP/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.009,85
CAIXA PENEDES CAPITAL, S.A.	KYG1755N1079	CA.PENEDES.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.004,81
CAIXA PREFERENCE, S.A.	KYG175471039	CAIXA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.002,99
CAIXA PREFERENCE, S.A.	KYG175471112	CAIXA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.003,27
CAIXA TERRASSA, SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREF	KYG175491094	TERRASSA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.003,92
CAIXABANK, S.A.	ES0114970009	LACAIXA/VAR NACU AMTB PPR I		V	611,21
CAIXANOVA EMISIONES, S.A.U.	ES0169075001	CAIXANOVA.EM/VAR NACU AMTB PPR A		V	59,79
CAIXANOVA EMISIONES, S.A.U.	ES0169075050	CAIXANOVA.EM/VAR NACU AMTB PPR D		V	97,88
CAIXASABADELL PREFERENTS, S.A.U.	ES0101339002	CAIXASAB.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.003,95
CAIXASABADELL PREFERENTS, S.A.U.	ES0101339028	CAIXASAB.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	13.239,89
CAJA DE AVILA PREFERENTES, S.A.U.	ES0122707005	CA.AVILA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.006,82
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SDAD DE PART. PREF.	ES0115372007	CA.ESPAÑA.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	965,28
CAJA MADRID FINANCE PREFERRED, S.A.	ES0115373005	CA.MAD.FIN.PREF/VAR NACU AMTB PPR I		V	93,23
CAJA MADRID FINANCE PREFERRED, S.A.	ES0115373021	CA.MAD.FIN.PREF/VAR NACU AMTB PPR 2		V	101,97
CAJA RIOJA PREFERENTES, S.A.	ES0113698007	CA.RIOJA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	506,43
CAJAGRANADA PREFERENTES, S.A.U.	ES0158952004	CAGRANADA.PREF./VAR NACU AMTB PPR A		V	101,06
CAJAMURCIA FINANCE, S.A.	KYG175552051	CAJAMURCIA.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	502,55
CAJAMURCIA PREFERENTES, S.A.U.	ES0114818000	CAJAMURCIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	505,94
CAJAMURCIA PREFERENTES, S.A.U.	ES0114818059	CAJAMURCIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR E		V	503,26
CAJASOL PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.	KYG1755U1195	CAJASOL.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	300,45
CAM CAPITAL, S.A., SOCIEDAD UNIPERSONAL	ES0114607007	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.010,03
CAM CAPITAL, S.A., SOCIEDAD UNIPERSONAL	KYG1793R1020	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	600,94
CAM CAPITAL, S.A., SOCIEDAD UNIPERSONAL	KYG1793R1103	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR B		V	601,06
CANTABRIA CAPITAL SOCIEDAD DE PARTICIPACIONES	KYG1825G1082	CANTABRIA.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	600,68
CANTABRIA PREFERENTES, S.A.	ES0182834004	CANTABRIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR I		V	1.001,81
CANTABRIA PREFERENTES, S.A.	ES0182834020	CANTABRIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR 2		V	1.000,75
CANTABRIA PREFERENTES, S.A.	ES0182834046	CANTABRIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR 3		V	1.005,92
EL MONTE CAPITAL, S.A.U.	KYG3014M1024	MONTE.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	501,04
EL MONTE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.	ES0128469006	EL.MONTE.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.002,32
EL MONTE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.	ES0128469022	EL.MONTE.PREF/VAR NACU AMTB PPR D		V	504,17
ENDESA CAPITAL FINANCE, L.L.C.	USU291871080	ELE.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR		V	21,42
GALLEGO PREFERENTES, S.A.U.	ES0170234001	GALLEGO.PREF/VAR NACU AMTB PPR 1		V	27.852,91
GUIPUZCOANO CAPITAL, S.A.	ES0143561001	GUI.CAP/VAR NACU AMTB PPR I		V	35,62
GUIPUZCOANO CAPITAL, S.A.	ES0143561043	GUI.CAP/VAR NACU AMTB PPR III		V	96,97
IBERCAJA BANCO, S.A.	ES0114954003	IBERCAJA/VAR NACU AMTB PPR 1ª		V	29.034,17
LA CAJA DE CANARIAS PREFERENTES, S.A.	ES0156844005	LA.CAJA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	501,78
LA CAJA DE CANARIAS PREFERENTES, S.A.	ES0156844054	LA.CAJA.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	504,68
PASTOR PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.U.	ES0168569004	PASTOR.PREF/VAR NACU AMTB PPR 1		V	100,00
POPULAR CAPITAL, S.A.	ES0170412003	POP.CAP./VAR NACU AMTB PPR D		V	100,00
REPSOL INTERNATIONAL CAPITAL LTD.	KYG7513K1379	REP.INTL.CAP/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.006,26
REPSOL INTERNATIONAL CAPITAL LTD.	KYG7513K1452	REP.INTL.CAP/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.003,79
SA NOSTRA DE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.I	KYG7803W1069	SA.NOSTRA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.002,85
SABADELL INTERNATIONAL EQUITY, LTD	KYG773751063	SAB.INTL.EQ/VAR NACU AMTB PPR A		V	501,90
SANTANDER FINANCE CAPITAL, S.A.U.	ES0175179078	SAN.FIN.CAP/VAR NACU AMTB PPR X		V	20,54
SOL MELIA FINANCE LIMITED	KYG8259W1033	SOL.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	87,53
SOS CORPORACION ALIMENTARIA PREFERENTES, S.A.I	ES0130124003	SOS.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	18.025,00
TELEFONICA FINANCE USA, L.L.C.	USU87942AA33	TEF.FIN.USA/VAR NACU AMTB PPR		V	1.002,57
UNION FENOSA FINANCIAL SERVICES USA, L.L.C.	USU90716AA64	UNF.FINL.USA/VAR NACU AMTB PPR		V	20,79

RENTA VARIABLE

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
AB-BIOTICS, S.A.	ES0109659013	AB-BIOTICS/AC 0,05			2,83
ABENGOA, S.A.	ES0105200416	ABG/AC A 1,00			16,66
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0111845014	ABE/AC 3,00			11,77
ACCIONA, S.A.	ES0125220311	ANA/AC 1,00			67,04
ACERINOX, S.A.	ES0132105018	ACX/AC 0,25			9,52
ACS, ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS, S	ES0167050915	ACS/AC 0,50			24,97
ADOLFO DOMINGUEZ, S.A.	ES0106000013	ADZ/AC 0,60			5,68
AGUAS DE SABADELL, CIA., S.A.	ES0107350011	AGUAS.SAB/AC B 12,02			65,70
ALFA, S.A.B. DE C.V.	MXP000511016	AC. ALFA S/A			8,40
ALMIRALL, S.A.	ES0157097017	ALM/AC 0,12			5,12
ALTIA CONSULTORES, S.A.	ES0113312005	ALTIA.CONSULT/AC 0,02			2,62
ALZA REAL ESTATE, S.A.	ES0138436011	ALZA/AC 1,00			3,96
AMADEUS IT HOLDING, S.A.	ES0109067019	AMS/AC A 0,01			12,53
AMERICA MOVIL, S.A.B. DE C.V.	MXP001691213	AC. AMERICA MOVIL. S/L			0,88
AMPER, S.A.	ES0109260531	AMP/AC 1,00			1,81
ANTENA 3 DE TELEVISION, S.A.	ES0109427734	A3TV/AC 0,75			4,33
APERAM SOCIETE ANONYME	LU0569974404	APAM/AC SVN			11,47
ARCELORMITTAL, S.A.	LU0323134006	ARCELORMITTAL/AC SVN			13,64
AYCO GRUPO INMOBILIARIO, S.A.	ES0152960011	AYCO.GRP.INMO/AC 3,01			9,80
AZKOYEN, S.A.	ES0112458312	AZK/AC 0,60			1,48
BANCA CIVICA, S.A.	ES0148873005	BCA.CIVICA/AC 1,00			2,27
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0113211835	BBVA/AC 0,49			6,23
BANCO BRADESCO, S.A.	BRBBDACACNPR8	AC. BANCO BRADESCO -PREF.-			12,30
BANCO DE CHILE, S.A.	CLP0939W1081	AC. BANCO DE CHILE			0,10
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0113860A34	SAB/AC 0,125			2,65
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0113980F34	BVA/AC 0,25			0,80
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0113440038	BTO/AC 0,79			3,98
BANCO PASTOR, S.A.	ES0113770434	PAS/AC 0,33			3,19
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0113790531	POP/AC 0,10			3,28
BANCO SANTANDER RIO, S.A.	ARBRI010194	AC. BCO SANTANDER RIO. S/B			1,33
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0113900J37	SAN/AC 0,50			5,83
BANKIA, S.A.	ES0113307039	BKIA/AC 2,00			3,55
BANKINTER, S.A.	ES0113679I37	BKT/AC 0,30			4,29
BARON DE LEY, S.A.	ES0114297015	BDL/AC 0,60			41,65
BAYER A.G.	DE000BAY0017	AC. BAYER			45,53
BBVA BANCO FRANCES, S.A.	ARP125991090	AC. BBVA BCO. FRANCES			1,55
BIOSEARCH, S.A.	ES0172233118	BIO/AC 0,24			0,49
BODACLICK, S.A.	ES0171957014	BODACLICK/AC 0,02			2,36
BODEGAS BILBAINAS, S.A.	ES0114930011	BODEGAS.BILB/AC 6,01			6,50
BODEGAS RIOJANAS, S.A.	ES0115002018	RIO/AC 0,75			5,10
BOLSAS Y MERCADOS ESPAÑOLES, SDAD HOLDING DE	ES0115056139	BME/AC 3,23			20,55
BRADESPAR, S.A.	BRBRAPACNOR5	AC. BRADESPAR			14,44
BRADESPAR, S.A.	BRBRAPACNPR2	AC. BRADESPAR -PREF.-			13,68
BRASKEM, S.A.	BRBRKMACNPA4	AC. BRASKEM -PREF.-			5,98
CAIXABANK, S.A.	ES0140609019	CABK/AC 1,00			3,60
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0114400007	CAM/CUPART 2,00			1,42
CAMPOFRIO FOOD GROUP, S.A.	ES0121501318	CFG/AC 1,00			6,30
CARTERA INDUSTRIAL REA, S.A.	ES0162292017	CART.IND.REA/AC 2,30			2,27
CATENON, S.A.	ES0112320009	CATENON/AC 0,02			2,28
CEMENTOS MOLINS, S.A.	ES0117360117	CEMENTOS.MOLINS/AC 0,30			8,19
CEMENTOS PORTLAND VALDERRIVAS, S.A.	ES0117390411	CPL/AC 1,50			8,91
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNOR6	AC. ELETROBRAS			6,98
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNPB7	AC. ELETROBRAS. PREF. S/B			9,87
CIE AUTOMOTIVE, S.A.	ES0105630315	CIE/AC 0,25			5,69
CLINICA BAVIERA, S.A.	ES0119037010	CBAV/AC 0,10			6,90
CODERE, S.A.	ES0119256115	CDR/AC 0,20			7,02
COMPANHIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	BRCMIGACNPR3	AC. CEMIG -PREF.-			12,04
COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	BRCPLEACNPB9	AC. COPEL -PREF.-			14,45
CONSTRUCCIONES Y AUXILIAR DE FERROCARRILES, S.	ES0121975017	CAF/AC 3,01			383,22
CORPORACION DERMOESTETICA, S.A.	ES0124204019	DERM/AC 0,10			0,74
CORPORACION FINANCIERA ALBA, S.A.	ES0117160111	ALB/AC 1,00			31,82
CORPORACION GEO, S.A.B. DE C.V.	MXP3142C1177	AC. GEO. S/B			0,95
DEOLEO, S.A.	ES0110047919	OLE/AC 0,50			0,39
DESARROLLOS ESPECIALES DE SISTEMAS DE ANCLAJE	ES0126251018	DESA/AC 0,50			12,50
DINAMIA CAPITAL PRIVADO, SCR, S.A.	ES0126501131	DIN/AC 3,00			3,87
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION, S.	ES0126775032	DIA/AC 0,10			3,24
DURO FELGUERA, S.A.	ES0162600417	MDF/AC 0,50			4,88
EBRO FOODS, S.A.	ES0112501012	EBRO/AC 0,60			14,20
ELECINOR, S.A.	ES0129743318	ENO/AC 0,10			9,65
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD, S.A.	CLP3710M1090	AC. ENDESA CHILE			1,13
ENAGAS, S.A.	ES0130960018	ENG/AC 1,50			13,93
ENDESA, S.A.	ES0130670112	ELE/AC 1,20			16,47
ENEL GREEN POWER, S.P.A.	IT0004618465	EGPW/AC 0,20			1,62
ENERSIS, S.A.	CLP371861061	AC. ENERSIS			0,27
ERCROS, S.A.	ES0125140A14	ECR/AC 0,30			0,78
ESPAÑOLA DE VIVIENDAS EN ALQUILER, CIA., S.A.	ES0132955016	CEVASA/AC 6,00			159,93
EURONA WIRELESS TELECOM, S.A.	ES0133443004	EURONA.WIRELESS/AC 1,00			1,49
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE AND SPACE COMP/	NL0000235190	AC. EADS			21,74
FAES FARMA, S.A.	ES0134950F36	FAE/AC 0,10			1,34
FERGO AISA, S.A.	ES0106585013	AISA/AC 0,25			0,11
FERROVIAL, S.A.	ES0118900010	FER/AC 0,20			9,12
FERSA ENERGIAS RENOVABLES, S.A.	ES0136463017	FRS/AC 1,00			0,78
FINANZAS E INVERSIONES VALENCIANAS, S.A.	ES0138152113	F&I.VALENCIANAS/AC 1,00			68,84
FLUIDRA, S.A.	ES0137650018	FDR/AC 1,00			2,16
FOMENTO DE CONSTRUCCIONES Y CONTRATAS, S.A.	ES0122060314	FCC/AC 1,00			18,87

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
FUNESPAÑA, S.A.	ES0140441017	FUN/AC 0,30			7,28
GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA, S.A.	ES0143416115	GAM/AC 0,17			3,38
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0116870314	GAS/AC 1,00			12,99
GENERAL DE ALQUILER DE MAQUINARIA, S.A.	ES0141571119	GALQ/AC 1,00			0,51
GERDAU, S.A.	BRGGBRACNPR8	AC. GERDAU -PREF.-			5,88
GRIFOLS, S.A.	ES0171996004	GRF/ACSVT B 0,10			8,75
GRIFOLS, S.A.	ES0171996012	GRF/AC A 0,50			12,80
GRUPO CATALANA OCCIDENTE, S.A.	ES0116920333	GCO/AC 0,30			12,30
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA, S.A.	COT13PA00011	AC. GRUPOSURA			12,43
GRUPO ELEKTRA, S.A. DE C.V.	MX01EL000003	AC. GRUPO ELEKTRA			65,29
GRUPO EMPRESARIAL ENCE, S.A.	ES0130625512	ENC/AC 0,90			1,90
GRUPO EMPRESARIAL SAN JOSE, S.A.	ES0180918015	GSJ/AC 0,03			2,66
GRUPO EZENTIS, S.A.	ES0172708317	EZE/AC 0,15			0,18
GRUPO FINANCIERO BANORTE S.A.B. DE C.V.	MXP370711014	AC. BANORTE S/O			2,39
GRUPO MODELO, S.A.B. DE C.V.	MXP4833F1044	AC. GRUPO MODELO. S/C			4,54
GRUPO NOSTRUM RNL, S.A.	ES0162603007	GRUPO.NOSTRUM/AC 1,00			4,40
GRUPO TAVEX, S.A.	ES0108180219	TVX/AC 0,92			0,35
HULLERA VASCO-LEONESA, S.A., SDAD.	ES0146940012	HULLERA.VAS-LE/AC 3,01			3,08
IBERDROLA, S.A.	ES0144580Y14	IBE/AC 0,75			4,97
IBERPAPEL GESTION, S.A.	ES0147561015	IBG/AC 0,60			13,03
IMAGINARIUM, S.A.	ES0147791018	IMAGINARIUM/AC 0,03			1,69
INDRA SISTEMAS, S.A.	ES0118594417	IDR/AC A 0,20			10,88
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL, S.A.	ES0148396015	ITX/AC 0,15			64,22
INMOBILIARIA COLONIAL, S.A.	ES0139140042	COL/AC 1,00			2,72
INMOBILIARIA DEL SUR, S.A.	ES0154653911	ISUR/AC 2,00			6,74
INMOLEVANTE, S.A.	ES0154949012	INMOLEVANTE/AC 3,00			8,54
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP, S.A	ES0177542018	IAG/AC 0,50			1,78
INVERFIATC, S.A.	ES0143419317	INVERFIATC/AC 1,00			0,44
INVERSIONES MOBILIARIAS BARCINO, S.A.	ES0155972237	INV.MOB.BARCINO/AC 1,00			1,66
INYPSA INFORMES Y PROYECTOS, S.A.	ES0152768612	INY/AC 0,50			1,03
JAZZTEL, PLC.	GB00B5TMS21	JAZ/AC 0,80			4,00
LABORATORIOS FARMACEUTICOS ROVI, S.A.	ES0157261019	ROVI/AC 0,06			5,11
LET'S GOWEX, S.A.	ES0158252017	LET'S.GOWEX/AC 0,05			4,61
LEVANTINA DE EDIFICACION Y OBRAS PUBLICAS, CIA, S	ES0158300410	CLEO/AC 1,00			2,92
LIBERTAS 7, S.A.	ES0137998A12	LIBERTAS.7/AC 0,50			6,63
LINGOTES ESPECIALES, S.A.	ES0158480311	LGT/AC 1,00			3,04
LOGISTICA DE HIDROCARBUROS CLH, CIA., S.A.	ES0110480219	CLH/AC D 1,20			27,57
LUMAR NATURAL SEAFOOD, S.A.	ES0158746026	LUMAR/AC 1,00			4,53
MAPFRE, S.A.	ES0124244E34	MAP/AC 0,10			2,50
MEDCOM TECH, S.A.	ES0161857018	MEDCOM.TECH/AC 0,01			2,50
MEDIASET ESPAÑA COMUNICACION, S.A.	ES0152503035	TL5/AC 0,50			4,40
MELIA HOTELS INTERNACIONAL, S.A.	ES0176252718	MEL/AC 0,20			4,56
METROVACESA, S.A.	ES0154220414	MVC/AC 1,50			1,14
MIQUEL Y COSTAS & MIQUEL, S.A.	ES0164180012	MCM/AC 2,00			17,99
MONTEBALITO, S.A.	ES0116494016	MTB/AC 1,00			1,15
NACIONAL FINANCIERA, S.N.C.	MX1BNA060006	NAFINSA/CERT NAFTRAC 2002			1,92
NATRA, S.A.	ES0165515117	NAT/AC 1,20			0,96
NATRACEUTICAL, S.A.	ES0165359011	NTC/AC 0,10			0,17
NEGOCIO & ESTILO DE VIDA, S.A.	ES0165946015	NEGOCIO.ESTILO/AC 0,01			1,21
NET SERVIÇOS DE COMUNICAÇÃO, S.A.	BRNETCACNPR3	AC. NET SERVIÇOS DE COMUNICAÇÃO -PR			7,13
NEURON BIOPHARMA, S.A.	ES0166198012	NEURON.BIOPH./AC 1,00			1,95
NH HOTELES, S.A.	ES0161560018	NHH/AC 2,00			3,00
NICOLAS CORREA, S.A.	ES0166300212	NEA/AC 0,80			1,16
OBRASCON HUARTE LAIN, S.A.	ES0142090317	OHL/AC 0,60			19,42
PAPELES Y CARTONES DE EUROPA, S.A.	ES0168561019	PAC/AC 2,00			2,76
PESCANOVA, S.A.	ES0169350016	PVA/AC 6,00			25,04
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNOR9	AC. PETROBRAS			9,45
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNPR6	AC. PETROBRAS -PREF.-			8,69
PRIM, S.A.	ES0170884417	PRM/AC 0,25			3,81
PROMOTORA DE INFORMACIONES, S.A.	ES0171743042	PRS/ACSVT CONV B 0,10			0,91
PROMOTORA DE INFORMACIONES, S.A.	ES0171743117	PRS/AC A 0,10			0,82
PROSEGUR, CIA. DE SEGURIDAD, S.A.	ES0175438235	PSG/AC 0,60			32,62
QUABIT INMOBILIARIA, S.A.	ES0110944016	QBT/AC 0,20			0,10
REALIA BUSINESS, S.A.	ES0173908015	RLIA/AC 0,24			1,14
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0173093115	REE/AC 2,00			33,43
RENO DE MEDICI, S.P.A.	IT0001178299	AC. RENO DE MEDICI. S/A			0,16
RENTA 4 BANCO, S.A.	ES0173358039	R4/AC 0,45			5,03
RENTA CORPORACION REAL ESTATE, S.A.	ES0173365018	REN/AC 1,00			1,05
REPSOL YPF, S.A.	ES0173516115	REP/AC 1,00			21,81
REYAL URBIS, S.A.	ES0122761010	REY/AC 0,01			0,55
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES0182870214	SYV/AC 1,00			4,64
SARE, S.A.B., DE C.V.	MX01SA030007	AC. SARE. S/B			0,07
SECUOYA GRUPO DE COMUNICACION, S.A.	ES0131703003	SECUOYA.COM/AC 0,0125			4,44
SEDA DE BARCELONA, LA, S.A.	ES0175290115	SED/AC 0,10			0,06
SERVICE POINT SOLUTIONS, S.A.	ES0143421G11	SPS/AC 0,60			0,25
SNIACE, S.A.	ES0165380017	SNC/AC 0,10			1,13
SOCIEDAD ANONIMA DAMM	ES0125690513	DAMM/AC 0,20			5,94
SOLARIA ENERGIA Y MEDIO AMBIENTE, S.A.	ES0165386014	SLR/AC 0,01			1,33
SOTOGRADE, S.A.	ES0138109014	STG/AC 0,60			2,98
TECNICAS REUNIDAS, S.A.	ES0178165017	TRE/AC 0,10			26,42
TECNOCOM, TELECOMUNICACIONES Y ENERGIA, S.A.	ES0147582B12	TEC/AC 0,50			1,39
TELEFONICA, S.A.	ES0178430E18	TEF/AC 1,00			14,12
TELEFONOS DE MEXICO, S.A.B. DE C.V.	MXP904131325	AC. TELMEX. S/L			0,55
TESTA INMUEBLES EN RENTA, S.A.	ES0170885018	TST/AC 6,00			7,01
TR HOTEL JARDIN DEL MAR, S.A.	ES0179598000	TR.JARDIN.MAR/AC 1,00			1,10

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
TUBACEX, S.A.	ES0132945017	TUB/AC 0,45			1,86
TUBOS REUNIDOS, S.A.	ES0180850416	TRG/AC 0,10			1,62
TV AZTECA, S.A. DE C.V.	MXP740471117	AC. TV AZTECA			0,45
UNION EUROPEA DE INVERSIONES, S.A.	ES0181480114	U.EUROPEA.INV/AC 1,00			7,66
UNIPAPEL, S.A.	ES0182045312	UPL/AC 1,50			12,72
URALITA, S.A.	ES0182170615	URA/AC 0,72			1,98
URBAR INGENIEROS, S.A.	ES0182484214	URBAR.ING/AC 0,50			4,50
URBAS GRUPO FINANCIERO, S.A.	ES0182280018	URBAS/AC 0,10			0,03
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNOR3	AC. USIMINAS			8,58
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNPA6	AC. USIMINAS -PREF.-			4,53
VALE, S.A.	BRVALEACNORO	AC. VALE			17,54
VALE, S.A.	BRVALEACNPA3	AC. VALE. PREF. 6%			16,51
VERTICE TRESCIENTOS SESENTA GRADOS, S.A.	ES0183304312	VER/AC 0,50			0,15
VIDRALA, S.A.	ES0183746314	VID/AC 1,02			18,86
VINICOLA DEL NORTE DE ESPAÑA, S.A., CIA.	ES0184140210	CUN/AC 0,24			14,26
VISCOFAN, S.A.	ES0184262212	VIS/AC 0,70			27,47
VOCENTO, S.A.	ES0114820113	VOC/AC 0,20			1,82
VOLCAN COMPAÑIA MINERA, S.A.A.	PEP648014202	AC. VOLCAN. PREF. S/B			0,71
VUELING AIRLINES, S.A.	ES0184591032	VLG/AC 1,00			4,63
ZARDOYA OTIS, S.A.	ES0184933812	ZOT/AC 0,10			9,82
ZELTIA, S.A.	ES0184940817	ZEL/AC 0,05			1,55
ZINKIA ENTERTAINMENT, S.A.	ES0184849018	ZNK/AC 0,10			1,40