

ANEXO A LA ORDEN DE

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

Criterio de ordenación:

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

RENTA FIJA

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

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

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

(*) ANCV: Agencia Nacional de Codificación de Valores

(**) V: Cupón Variable, C: Cupón Cero

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012008	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20400730	30/07/2040	C	24,793
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000120U5	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20380730	30/07/2038	C	26,541
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000120X9	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20121031	31/10/2012	C	94,725
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000120Y7	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20121031	31/10/2012	C	94,338
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000120Z4	ESTADO/4,10 BOEST SEGR 20110430	30/04/2011	4,100	104,164
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012106	PRINCIPAL SEGREGADO	30/07/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012114	PRINCIPAL SEGREGADO	30/07/2004	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012122	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20090730	30/07/2009	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012155	CUPON SEGREGADO	30/07/2002	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012163	CUPON SEGREGADO	30/07/2003	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012171	CUPON SEGREGADO	30/07/2004	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012189	CUPON SEGREGADO	30/07/2005	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012197	CUPON SEGREGADO	30/07/2006	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121A5	ESTADO/4,10 OBE SEGR 20180730	30/07/2018	4,100	103,702
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121F4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20180730	30/07/2018	C	72,875
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121G2	ESTADO/4,80 OBESEGR 20240131	31/01/2024	4,800	105,970
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121H0	ESTADO/4,25 BOEST SEGR 20140131	31/01/2014	4,250	106,992
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121I8	ESTADO/2,75 BOEST SEGR 20120430	30/04/2012	2,750	102,578
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121K4	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20240131	31/01/2024	C	53,113
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121L2	ESTADO/4,60 OBESEGR 20190730	30/07/2019	4,600	106,649
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121M0	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20120430	30/04/2012	C	96,123
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121O6	ESTADO/4,30 OBESEGR 20191031	31/10/2019	4,300	103,902
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121P3	ESTADO/3,30 BOEST SEGR 20141031	31/10/2014	3,300	102,603
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121Q1	ESTADO/VAR BOEST SEGR 20121029	29/10/2012	V	99,982
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121S7	ESTADO/4,00 OBESEGR 20100131	30/07/2041	4,700	101,528
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES00000121T5	ESTADO/2,30 BOEST SEGR 20130430	30/04/2013	2,300	100,247
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012205	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20070730	30/07/2007	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012213	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20080730	30/07/2008	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012221	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20090730	30/07/2009	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012239	ESTADO/4,00 OBE SEGR 20100131	31/01/2010	4,000	100,680
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012247	BONOS SEGREGABLES DEL TESORO	31/01/2003	3,000	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012254	BONOS SEGREGABLES DEL TESORO	31/01/2005	3,250	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012270	PRINCIPAL SEGREGADO	31/01/2003	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012288	PRINCIPAL SEGREGADO	31/01/2005	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012296	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20100131	31/01/2010	C	99,843
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012304	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20140730	30/07/2014	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012312	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20100730	30/07/2010	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012320	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20110730	30/07/2011	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012338	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20120730	30/07/2012	C	94,937
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012346	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20130730	30/07/2013	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012353	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20140730	30/07/2014	C	88,530
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012361	BONOS SEGREGABLES DEL TESORO	30/07/2003	4,600	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012379	BONOS SEGREGABLES DEL TESORO	30/07/2005	4,950	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012387	ESTADO/5,40 OBE SEGR 20110730	30/07/2011	5,400	106,864
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012395	PRINCIPAL SEGREGADO	30/07/2003	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012403	PRINCIPAL SEGREGADO	30/07/2005	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012411	ESTADO/5,75 OBE 20320730	30/07/2032	5,750	116,902
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012429	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20110730	30/07/2011	C	97,885
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012437	BONOS SEGREGABLES DEL TESORO	31/10/2004	4,650	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012445	BONOS SEGREGABLES DEL TESORO	31/10/2006	4,800	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012452	ESTADO/5,35 OBE SEGR 20111031	31/10/2011	5,350	107,524
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012460	PRINCIPAL SEGREGADO	31/10/2004	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012502	PRINCIPAL SEGREGADO	31/10/2006	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012510	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20111031	31/10/2011	C	97,254
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012593	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20320730	30/07/2032	C	34,053
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012601	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20150730	30/07/2015	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012619	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20160730	30/07/2016	C	80,750
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012627	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170730	30/07/2017	C	77,208
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012635	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20180730	30/07/2018	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012643	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20190730	30/07/2019	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012650	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20200730	30/07/2020	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012668	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20210730	30/07/2021	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012676	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20220730	30/07/2022	C	58,401
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012684	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20230730	30/07/2023	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012692	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20240730	30/07/2024	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012700	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20250730	30/07/2025	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012718	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20260730	30/07/2026	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012726	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20270730	30/07/2027	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012734	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20280730	30/07/2028	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012742	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20290730	30/07/2029	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012759	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20300730	30/07/2030	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012767	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20310730	30/07/2031	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012775	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20320730	30/07/2032	C	
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012783	ESTADO/5,50 OBE SEGR 20170730	30/07/2017	5,500	114,199
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012791	ESTADO/5,00 OBE SEGR 20120730	30/07/2012	5,000	108,369
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012817	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20170730	30/07/2017	C	76,942
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012866	ESTADO/4,20 OBE SEGR 20130730	30/07/2013	4,200	106,709
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012874	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20130730	30/07/2013	C	92,049
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012916	ESTADO/4,40 OBE SEGR 20150131	31/01/2015	4,400	107,662
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0000012932	ESTADO/4,20 OBE SEGR 20370131	31/01/2037	4,200	94,446
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES00000950A7	GENCAT/VAR BO 20110428	28/04/2011	V	101,322
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES00000952S9	GENCAT/11,65 OB 20100619	19/06/2010	11,650	105,274
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095606	GENCAT/5,325 OB 20281005	05/10/2028	5,325	100,136
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095721	GENCAT/5,80 OB 20101130	30/11/2010	5,800	101,730
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095788	GENCAT/VAR OB 20171017	17/10/2017	V	97,899

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095812	GENCAT/VAR OB 20180613	13/06/2018	V	85,715
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095846	GENCAT/3,75 BO 20100215	15/02/2010	3,750	100,845
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095853	GENCAT/4,69 OB 20341028	28/10/2034	4,690	87,170
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095861	GENCAT/3,875 OB 20150915	15/09/2015	3,875	104,797
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095879	GENCAT/4,22 OB 20350426	26/04/2035	4,220	84,549
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095887	GENCAT/3,25 OB 20111130	30/11/2011	3,250	102,275
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095895	GENCAT/4,30 OB 20161115	15/11/2016	4,300	104,048
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095903	GENCAT/4,12 BO 20130423	23/04/2013	4,125	104,130
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095911	GENCAT/3,85 BO 20110930	30/09/2011	3,850	103,322
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095929	GENCAT/4,75 OB 20180604	04/06/2018	4,750	102,598
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095A54	GENCAT/PAG 20100209	09/02/2010		99,911
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095A62	GENCAT/PAG 20100223	23/02/2010		99,857
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095A88	GENCAT/PAG 20100323	23/03/2010		99,826
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095A96	GENCAT/PAG 20100119	19/01/2010		99,811
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095B12	GENCAT/PAG 20100511	11/05/2010		99,758
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095B20	GENCAT/PAG 20100608	08/06/2010		99,515
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095B38	GENCAT/PAG 20100706	06/07/2010		99,158
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095B46	GENCAT/PAG 20100309	09/03/2010		99,812
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095B61	GENCAT/PAG 20101005	05/10/2010		98,784
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095B87	GENCAT/PAG 20101109	09/11/2010		98,824
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095B95	GENCAT/PAG 20101207	07/12/2010		98,782
GOBIERNO VASCO	ES0000106429	GOB.VASCO/5,55 OB 20141126	26/11/2014	5,550	111,683
GOBIERNO VASCO	ES0000106437	GOB.VASCO/4,15 OB 20191028	28/10/2019	4,150	99,952
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0255281059	INST.CAT.FIN/VAR OB 20131204	04/12/2013	V	97,789
INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL	ES0200130278	ICO/6,75 OB 20070102	02/01/2007	6,750	
INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL	ES0200130351	ICO/6,00 OB 20070707	07/07/2007	6,000	
INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL	ES0200130393	OB. ICO	18/12/2003	5,000	
INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL	ES0300130194	BO. ICO. % VAR	26/11/2002	V	
JUNTA DE ANDALUCIA	ES0000090227	BO. JUNTA DE ANDALUCIA	27/02/2002	7,100	
JUNTA DE ANDALUCIA	ES0000090268	BO. JUNTA DE ANDALUCIA	26/02/2003	5,500	
JUNTA DE ANDALUCIA	ES0000090292	BO. SEGREGABLES JUNTA DE ANDALUCIA	30/07/2002	4,200	
JUNTA DE ANDALUCIA	ES0000090300	BO. SEGREGABLES JUNTA DE ANDALUCIA	30/07/2004	4,400	
JUNTA DE ANDALUCIA	ES0000090391	BO. JUNTA DE ANDALUCIA	15/11/2004	3,750	
JUNTA DE ANDALUCIA	ES0000090409	JUNTA.AND/5,375 OB SEGR 20120530	30/05/2012	5,375	107,500
JUNTA DE ANDALUCIA	ES05000900G8	PAG. JUNTA DE ANDALUCIA	26/04/2002		
JUNTA DE ANDALUCIA	ES05000900M6	PAG. JUNTA DE ANDALUCIA	25/10/2002		
SOCIEDAD ESTATAL DE PARTICIPACIONES INDUSTRIALES	ES0202010023	OB. INI	27/04/2003	11,300	
SOCIEDAD ESTATAL DE PARTICIPACIONES INDUSTRIALES	ES0202010049	SEPI/8,64 OB 20081220	20/12/2008	8,640	
XUNTA DE GALICIA	ES0001352055	XUNTA/12,80 OB 20071228	28/12/2007	12,800	
XUNTA DE GALICIA	ES0001352147	XUNTA/5,40 OB 20180720	20/07/2018	5,400	
XUNTA DE GALICIA	ES0001352170	XUNTA/VAR OB 20081203	03/12/2008	V	
XUNTA DE GALICIA	ES0001352287	XUNTA/4,10 BO 20140612	12/06/2014	4,100	103,760
XUNTA DE GALICIA	ES0001352295	XUNTA/4,205 BO 20191130	30/11/2019	4,205	100,000

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

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0000230211	BCO.CTO.LOCAL/4,00 CEDHIP 20120331	31/03/2012	4,000	5,76
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0255281083	INST.CAT.FIN/4,50 OB 20150423	23/04/2015	4,500	101,919
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0255281125	INST.CAT.FIN/4,10 OB 20151030	30/10/2015	4,100	100,000
INSTITUTO CATALAN DE FINANZAS	ES0255281133	INST.CAT.FIN/VAR OB 20291022	22/10/2029	V	99,750

LETRAS DEL TESORO

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

OBLIGACIONES

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845179	ABE/4,75 OB 20140211	11/02/2014	4,750	106.388,46
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845187	ABE/4,95 OB 20130808	08/08/2013	4,950	107.284,56
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845203	ABE/4,375 OB 20200330	30/03/2020	4,375	97.997,35
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845211	ABE/5,125 OB 20170612	12/06/2017	5,125	53.600,16
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845237	ABE/4,625 OB 20161014	14/10/2016	4,625	49.987,68
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR-LEONESA, S.A.	ES0211843083	AUCALSA/4,00 OB 20140608	08/06/2014	4,000	488,72
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR-LEONESA, S.A.	ES0211843091	AUCALSA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3,700	466,33
AUTOPISTA VASCO-ARAGONESA, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211837077	AVASA/3,55 OB 20150615	15/06/2015	3,550	946,11
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839107	AUDASA/4,19 OB 20110531	31/05/2011	4,190	492,39
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839115	AUDASA/4,33 OB 20120516	16/05/2012	4,330	616,02
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839123	AUDASA/3,83 OB 20130626	26/06/2013	3,830	507,83
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839131	AUDASA/4,00 OB 20140608	08/06/2014	4,000	488,46
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839149	AUDASA/3,32 OB 20151212	12/12/2015	3,320	465,29
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839156	AUDASA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3,700	468,23
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839164	AUDASA/4,85 OB 20180327 GTIA	27/03/2018	4,850	489,66
AUTOVIA DE LOS VIÑEDOS, S.A.CONCES.D LA JUNTA DE COMUN	ES0211966009	AUVISA/4,79 OB 20271215	15/12/2027	4,790	84.330,67
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211081	BBVA/VAR OB SUBD 20151112	12/11/2015	V	100.110,59
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211099	BBVA/VAR OB SUBD 20191020	20/10/2019	V	101.769,74
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211123	BBVA/CUPCER OBESTR 20160411	11/04/2016	C	56.290,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213180013	ATL/VAR OB SUBD 20101001	01/10/2010	V	600,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860036	SAB/VAR OB SUBD 20160525	25/05/2016	V	86.787,44
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980016	BVA/VAR OB SUBD 20110329	29/03/2011	V	6.014,25
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980024	BVA/VAR OB SUBD 20141215	15/12/2014	V	3.011,13
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980040	BVA/VAR OB SUBD 20170323	23/03/2017	V	47.305,24
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051008	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20130630	30/06/2013	V	599,47
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051016	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20131030	30/10/2013	V	598,92
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051024	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20160421	21/04/2016	V	48.756,89
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051057	BCO.GALLEGO/VAR OBSUBD 20191229	29/12/2019	V	100,00
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580006	GUI/4,75 OB SUBD 20110415	15/04/2011	4,750	500,69
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580014	GUI/4,50 OB SUBD 20121015	15/10/2012	4,500	502,25
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580022	GUI/4,20 OB SUBD 20141015	15/10/2014	4,200	500,31
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0213790001	POP/VAR OBSUBD 20191222	22/12/2019	V	50.078,91
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0213900147	SAN/12,70 OB SUBD 20101226	26/12/2010	12,700	167.022,77
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0213540018	BBE/VAR OB SUBD 20160323	23/03/2016	V	97.435,20
BANKINTER, S.A.	ES0213679121	BKT/VAR OB 20150316	16/03/2015	V	497,31
BANKINTER, S.A.	ES0213679188	BKT/VAR OBSUBD 20181010	10/10/2018	V	50.000,00
BANKINTER, S.A.	ES0213679196	BKT/6,375 OBSUBD 20190911	11/09/2019	6,375	51.830,55
BARCLAYS BANK, S.A.	ES0214050041	ZRG/VAR OB SUBD 20110101	01/01/2011	V	600,00
BILBAO BIZKAIA KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA	ES0214100002	BBK/VAR OB SUBD 20150928	28/09/2015	V	89.493,48
BILBAO BIZKAIA KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA	ES0214100010	BBK/VAR OB SUBD 20160301	01/03/2016	V	89.686,92
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0257080004	BPEF/VAR OB SUBD 20140630	30/06/2014	V	943,65
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0214958011	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20180108	08/01/2018	V	29,79
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0214958029	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20180804	04/08/2018	V	600,02
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0214958037	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20190126	26/01/2019	V	600,00
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0214958052	CAIXANOVA/VAR OB SUBD PERP		V	34.476,82
CAIXA D'ESTALVIS COMARCAL DE MANLLEU	ES0214841027	CA.MANLLEU/VAR OB SUBD 20130601	01/06/2013	V	499,94
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840201	CA.CATALUNYA/VAR OB SUBD 20150519	19/05/2015	V	1.500,05
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840235	CA.CATALUNYA/VAR OB SUBD 20200220	20/02/2020	V	1.500,09
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840250	CA.CATALUNYA/VAR OB 20120706	06/07/2012	V	95.659,35
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840342	CA.CATALUNYA/VAR OBSUBD 20181218	18/12/2018	V	500,08
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0213249008	CA.GIRONA/VAR OB SUBD 20160921	21/09/2016	V	94.923,65
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0214973077	CA.SABADELL/VAR OBSUBD 20240610	10/06/2024	V	990,47
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0314973027	CA.SABADELL/VAR OB SUBD PERP		V	599,29
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346000	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20150527	27/05/2015	V	600,00
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346018	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20151027	27/10/2015	V	600,00
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346026	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20160427	27/04/2016	V	600,01
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346034	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20161027	27/10/2016	V	600,00
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346042	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20170127	27/01/2017	V	500,00
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346059	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20171127	27/11/2017	V	500,01
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346067	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20180727	27/07/2018	V	500,01
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974018	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD PERP		V	601,01
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974034	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20131230	30/12/2013	V	1.000,07
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974042	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20190730	30/07/2019	V	1.000,16
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974067	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20210809	09/08/2021	V	84.006,28
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974091	CA.TERRASSA/VAR OB 20170627	27/06/2017	V	70.859,33
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974117	CA.TERRASSA/VAR OBSUBD 20190929	29/09/2019	V	999,41
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966006	CA.PENEDES/VAR OB SUBD PERP		V	600,56
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966014	CA.PENEDES/VAR OB SUBD PERP		V	999,50
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966022	CA.PENEDES/VAR OB SUBD 20161222	22/12/2016	V	999,53
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966030	CA.PENEDES/VAR OBSUBD 20190629	29/06/2019	V	999,46
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0214846042	CA.LAIETANA/VAR OB SUBD 20211010	10/10/2021	V	999,82
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0214846059	CA.LAIETANA/VAR OB SUBD 20350315	15/03/2035	V	999,81
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979066	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20111106	06/11/2011	V	1.000,00
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979082	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20121001	01/10/2012	V	1.000,00
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979132	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20141025	25/10/2014	V	1.000,01
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979157	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20151128	28/11/2015	V	999,89
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979173	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20171227	27/12/2017	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0214826010	CAJASTUR/VAR OBSUBD 20190616	16/06/2019	V	100,00
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214825012	CA.ALBACETE/VAR OB SUBD PERP		V	609,29
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214825020	CA.ALBACETE/VAR OB SUBD PERP		V	607,13
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214842017	CA.CUENCA-C.R./VAR OB SUBD PERP		V	302,29
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214842025	CA.CUENCA-C.R./VAR OB PREF PERP		V	305,06
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424096	CCM/VAR OB SUBD 20110604	04/06/2011	V	600,01
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424138	CCM/VAR OB SUBD 20171214	14/12/2017	V	93.343,84
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424161	CCM/VAR OB SUBD PERP		V	73.700,04

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843015	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD PERP		V	598,56
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843023	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD PERP		V	600,98
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843080	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20121001	01/10/2012	V	577,72
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843098	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20131103	03/11/2013	V	585,51
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843106	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20140401	01/04/2014	V	584,49
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843114	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20150104	04/01/2015	V	565,36
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843122	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20150704	04/07/2015	V	567,42
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843130	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20160912	12/09/2016	V	41.995,30
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845002	CAI/VAR OB SUBD 20131222	22/12/2013	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845010	CAI/VAR OB SUBD 20140629	29/06/2014	V	98.678,41
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845036	CAI/VAR OB SUBD 20190228	28/02/2019	V	999,99
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600035	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	302,41
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600043	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	303,53
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600050	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	300,45
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600084	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	300,49
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600092	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	300,49
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600175	CA.MURCIA/VAR OB SUBD 20141215	15/12/2014	V	299,97
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600191	CA.MURCIA/VAR OB SUBD 20230630	30/06/2023	V	500,00
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0214854012	CAJADUERO/VAR OBSUBD 20150630	30/06/2015	V	41.895,97
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0214854038	CAJADUERO/VAR OBSUBD 20190928	28/09/2019	V	998,11
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0214975007	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20121010	10/10/2012	V	999,98
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0214975015	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20140330	30/03/2014	V	999,98
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0214975023	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20151213	13/12/2015	V	47.951,80
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977037	BANCAJAVAR OB SUBD PERP		V	601,38
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977052	BANCAJAVAR OB SUBD 20220704	04/07/2022	V	1.000,02
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977060	BANCAJA/3,94 OB 20150918	18/09/2015	3,940	1.000,30
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977078	BANCAJAVAR OB SUBD 20181129	29/11/2018	V	65.562,87
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977086	BANCAJAVAR OB 20120606	06/06/2012	V	91.725,88
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977094	BANCAJAVAR OB 20160125	25/01/2016	V	76.498,13
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977102	BANCAJAVAR OB SUBD PERP		V	50.934,99
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977128	BANCAJA/4,25 OB 20130526	26/05/2013	4,250	95.246,29
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977136	BANCAJAVAR OB 20130923	23/09/2013	V	85.200,76
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977144	BANCAJA/4,375 OB 20170214	14/02/2017	4,375	85.271,28
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977151	BANCAJAVAR OB 20140423	23/04/2014	V	42.386,36
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977169	BANCAJAVAR OB OBSUBD 20190706	06/07/2019	V	997,57
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0215307028	CA.SAGUNTO/VAR OB SUBD PERP		V	601,03
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0215307036	CA.SAGUNTO/VAR OB SUBD 20120630	30/06/2012	V	602,21
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZK	ES0214957013	CA.VITAL/10,00 OB SUBD PERP		10,000	301,44
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0214400014	CAM/VAR OB SUBD PERP		V	603,26
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0214400048	CAM/VAR OB SUBD PERP		V	600,00
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0214400055	CAM/VAR OB 20150815	15/08/2015	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0215395015	CAM/VAR OB SUBD PERP		V	608,70
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0264730039	CAJASUR/VAR OB SUBD 20131201	01/12/2013	V	500,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES0214987028	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20171115	15/11/2017	V	500,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES0214987044	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20191021	21/10/2019	V	500,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES0214987069	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20200401	01/04/2020	V	500,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES0214987077	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20210425	25/04/2021	V	7.438,80
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES0214926018	SA.NOSTRA/VAR OB SUBD 20141230	30/12/2014	V	95.514,63
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES0214926026	SA.NOSTRA/VAR OB SUBD 20150318	18/03/2015	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES0214926034	SA.NOSTRA/VAR OBSUBD 20190630	30/06/2019	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950059	CA.MADRID/6,25 OB SUBD 20120410	10/04/2012	6,250	102.340,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950109	CA.MADRID/4,00 OB 20110302	02/03/2011	4,000	1.013,41
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950117	CA.MADRID/3,76 OB 20110331	31/03/2011	3,760	1.010,70
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950125	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20140715	15/07/2014	V	90.183,66
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950133	CA.MADRID/VAR OB 20120601	01/06/2012	V	98.232,24
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950141	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20180301	01/03/2018	V	82.519,84
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950158	CA.MADRID/VAR OB 20120209	09/02/2012	V	98.221,66
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950166	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20161017	17/10/2016	V	41.800,62
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950174	CA.MADRID/VAR OB 20140626	26/06/2014	V	994,96
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0214965024	CAN/VAR OBSUBD 20190630	30/06/2019	V	1.000,04
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT	ES0214955017	CA.ONTINYENT/VAR OB SUBD 20130528	28/05/2013	V	6.000,68
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT	ES0214955025	CA.ONTINYENT/VAR OB SUBD 20160428	28/04/2016	V	6.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0214959076	CA.SEGOVIA/VAR OB SUBD 20170620	20/06/2017	V	47.256,91
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0214954010	IBERCAJA/VAR OB PREF PERP		V	601,02
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0214954028	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP		V	601,02
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0214954036	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP		V	601,02
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0214954044	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP		V	601,02
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0214954135	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20180420	20/04/2018	V	450,13
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0214954150	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20190425	25/04/2019	V	396,90
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970032	LACAIXA/VAR OB SUBD 20111010	10/10/2011	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970040	LACAIXA/VAR OB SUBD 20120412	12/04/2012	V	10,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970057	LACAIXA/VAR OB SUBD 20120722	22/07/2012	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970065	LACAIXA/VAR OBSUBD 20190228	28/02/2019	V	1.000,00
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0215474026	CA.ESPAÑA/5,75 OB SUBD 20150627	27/06/2015	5,750	988,52
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0215474166	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20181229	29/12/2018	V	923,44
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0215474190	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20151207	07/12/2015	V	95.511,56
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0215474208	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20160131	31/01/2016	V	961,97
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0215474216	CA.ESPAÑA/VAR OB 20130517	17/05/2013	V	93.186,86
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0215474224	CA.ESPAÑA/VAR OB 20140326	26/03/2014	V	91.650,00
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0215474232	CA.ESPAÑA/7,50 OBSUBD 20180828	28/08/2018	7,500	1.026,92
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981013	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD PERP		V	620,73
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981039	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20321015	15/10/2032	V	299,87
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981054	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20200628	28/06/2020	V	290,40
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981070	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20151104	04/11/2015	V	86.901,72
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES0214982110	CA.GRANADA/VAR OB SUBD 20150630	30/06/2015	V	96.813,80

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES0214982136	CA.GRANADA/VAR OBSUBD 20190316	16/03/2019	V	999,86
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983019	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP		V	301,55
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983035	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP		V	303,22
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983084	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20120801	01/08/2012	V	599,99
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983092	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20131101	01/11/2013	V	500,08
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983118	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20150412	12/04/2015	V	96.854,72
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983126	LA.CAJA/VAR OB 20111005	05/10/2011	V	98.190,00
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983134	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP		V	37.207,69
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983142	LA.CAJA/VAR OBSUBD 20190902	02/09/2019	V	50.501,12
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CR	ES0215316029	RURALCAJA/VAR OB SUBD 20151122	22/11/2015	V	87.015,27
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0214601017	CAJAMAR/VAR OB SUBD 20150316	16/03/2015	V	84.383,16
DEUTSCHE BANK, A.G.	DE0003933693	OB. DEUTSCHE BANK	10/11/2014	4,155	975,99
DEUTSCHE BANK, SOCIEDAD ANONIMA ESPAÑOLA	ES0213320015	DT.BK.SAE/VAR OB SUBD 20131230	30/12/2013	V	95,71
DEUTSCHE BANK, SOCIEDAD ANONIMA ESPAÑOLA	ES0213320023	DT.BK.SAE/VAR OB SUBD 20140331	31/03/2014	V	95,66
ENAGAS, S.A.	ES0230960009	ENG/4,375 OB 20150706	06/07/2015	4,375	52.469,92
EROSKI SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429004	EROSKI/VAR OB SUBD PERP		V	25,00
EROSKI SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429038	EROSKI/VAR OB SUBD PERP		V	24,99
EUROPENNE POUR LE FINANCEMENT DE MATERIEL FER.	ES0233813163	EUROFIMA/11,00 OB 20141118	18/11/2014	11,000	8.315,93
FAGOR ELECTRODOMESTICOS, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0235972009	FAGOR/VAR OB SUBD 1ª PERP		V	24,81
FAGOR ELECTRODOMESTICOS, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0235972017	FAGOR/VAR OB SUBD 2ª PERP		V	25,05
IBERDROLA, S.A.	ES0244520138	HIDROLA/6,75 OB 20121215	15/12/2012	6,750	6,40
IBERDROLA, S.A.	ES0274760075	SALTOS.SIL/6,75 OB 20101101	01/11/2010	6,750	6,04
IBERDROLA, S.A.	ES0274760083	SALTOS.SIL/6,75 OB 20121001	01/10/2012	6,750	6,06
MAPFRE, S.A.	ES0224244055	MAP/6,02 OB 20110712	12/07/2011	6,020	105.701,39
MAPFRE, S.A.	ES0224244063	MAP/VAR OB SUBD 20370724	24/07/2037	V	43.208,07
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANDO DE HU	ES0217156092	EL.MONTE/VAR OB SUBD PERP		V	69.966,57
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANDO DE HU	ES0264870017	EL.MONTE/VAR OB SUBD PERP		V	1.517,22
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920029	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD PERP		V	618,10
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920045	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD PERP		V	600,86
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920052	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD PERP		V	600,93
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920060	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD 20211018	18/10/2021	V	599,84
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920078	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD 20230610	10/06/2023	V	599,90
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920086	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD 20250608	08/06/2025	V	599,86
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920094	CA.BADAJOZ/VAR OB SUBD 20220615	15/06/2022	V	599,83
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0213495007	SAN.CONS.FIN/VAR OB SUBD 20160928	28/09/2016	V	44.905,36
SOCIEDAD ESTATAL DE PARTICIPACIONES INDUSTRIALES	ES0202010064	SEPI/12,01 OB 20251228	28/12/2025	12,010	222.083,75
TELEFONICA, S.A.	ES0278430683	TEF/CUPCER OB 20100226	26/02/2010	C	3.140,33
UNIVERSIDAD DE VALENCIA - ESTUDI GENERAL	ES0282102005	UNIV.VAL/6,60 OB 20221215	15/12/2022	6,600	6.010,13
UNIVERSIDAD DE VALENCIA - ESTUDI GENERAL	ES0282102013	UNIV.VAL/5,55 OB 20131215	15/12/2013	5,550	6.010,13
UNIVERSIDAD POLITECNICA DE VALENCIA	ES0282103011	UPV/5,55 OB 20131215	15/12/2013	5,550	6.010,13
VIDACAIXA, S.A. DE SEGUROS Y REASEGUROS	ES0283691006	VIDACAIXA/VAR OB SUBD PERP		V	1.000,00
VIDACAIXA, S.A. DE SEGUROS Y REASEGUROS	ES0283691014	VIDACAIXA/VAR OB SUBD PERP		V	1.000,00

BONOS

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
AYT BONOS TESORERIA I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312348008	AYT.BO.TESOR.I/3,25 BTA 20100406 A	06/04/2010	3,250	100.282,12
AYT BONOS TESORERIA I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312348016	AYT.BO.TESOR.I/3,25 BTA 20100406 B	06/04/2010	3,250	98.476,67
AYT BONOS TESORERIA II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312271002	AYT.BO.TESOR.II/VAR BTA 20130224 A	24/02/2013	V	75.492,26
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298005	AYT.CCG/VAR BTA 20121214 I GTIA	14/12/2012	V	97.028,86
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298013	AYT.CCG/3,50 BTA 20160314 II GTIA	14/03/2016	3,500	96.655,33
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298021	AYT.CCG/3,75 BTA 20221214 III GTIA	14/12/2022	3,750	86.314,38
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298047	AYT.CCG/3,50 BTA 20110314 V GTIA	14/03/2011	3,500	102.151,34
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298054	AYT.CCG/4,00 BTA 20210324 VI GTIA	24/03/2021	4,000	91.421,75
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298062	AYT.CCG/VAR BTA 20170526 VII GTIA	26/05/2017	V	99.789,50
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298070	AYT.CCG/4,25 BTA 20180614 VIII GTIA	14/06/2018	4,250	98.258,23
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298088	AYT.CCG/3,75 BTA 20131025 IX GTIA	25/10/2013	3,750	100.998,77
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298096	AYT.CCG/4,25 BTA 20231025 X GTIA	25/10/2023	4,250	90.402,00
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298104	AYT.CCG/4,00 BTA 20161220 XI GTIA	20/12/2016	4,000	98.500,46
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298112	AYT.CCG/4,00 BTA 20170526 XII GTIA	21/03/2017	4,000	98.354,53
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298120	AYT.CCG/4,75 BTA 20270525 XIII GTIA	25/05/2027	4,750	93.786,98
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298138	AYT.CCG/VAR BTA 20190524 XIV GTIA	24/05/2019	V	99.781,36
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298203	AYT.CCG/4,00 BTA 20111229 XXI GTIA	29/12/2011	4,000	103.156,61
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298211	AYT.CCG/3,50 BTA 20120217 XXII GTIA	17/02/2012	3,500	101.848,88
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298229	AYT.CCG/4,75 BTA 20160615 XXIII	15/06/2016	4,750	99.483,86
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298237	AYT.CCG/4,25 BTA 20140729 XXIV GTIA	29/07/2014	4,250	102.505,63
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312298245	AYT.CCG/4,50 BTA 20191202 XXV GTIA	02/12/2019	4,500	98.056,48
AYT CEDULAS CAJAS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361002001	AYT.CED.CA.III/5,25 BTA 20120628	28/06/2012	5,250	106.607,09
AYT CEDULAS CAJAS IV, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312368006	AYT.CED.CA.IV/4,00 BTA 20130313	13/03/2013	4,000	102.445,33
AYT CEDULAS CAJAS IX, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312358007	AYT.CED.CA.IX/3,75 BTA 20150331 A	31/03/2015	3,750	99.483,86
AYT CEDULAS CAJAS IX, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312358015	AYT.CED.CA.IX/4,00 BTA 20200331 B	31/03/2020	4,000	91.417,27
AYT CEDULAS CAJAS V, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0307148019	AYT.CED.CA.V/4,75 BTA 20181204 B	04/12/2018	4,750	101.200,90
AYT CEDULAS CAJAS VI, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312360003	AYT.CED.CA.VI/4,00 BTA 20140407 A	07/04/2014	4,000	101.823,74
AYT CEDULAS CAJAS VII, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312361001	AYT.CED.CA.VII/4,00 BTA 20110623	23/06/2011	4,000	103.092,90
AYT CEDULAS CAJAS VIII, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312362009	AYT.CED.CA.VIII/4,00 BTA 20141118 A	18/11/2014	4,000	100.833,90
AYT CEDULAS CAJAS VIII, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312362017	AYT.CED.CA.VIII/4,25 BTA 20191118 B	18/11/2019	4,250	95.689,77
AYT CEDULAS CAJAS X, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312342019	AYT.CED.CA.X/3,75 BTA 20250630 B	30/06/2025	3,750	81.271,37
AYT CEDULAS CAJAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0352961009	AYT.CED.CA/5,25 BTA 20110420	20/04/2011	5,250	104.490,60
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A.	ES0312273487	COLAT.GLB.HIP./VAR BTA 20480325 A	25/03/2048	V	91.644,34
AYT DEUDA SUBORDINADA I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312284021	AYT.DEU.SUBD/VAR BTA 20161117 C	17/11/2016	V	33.215,00
AYT FONDO EOLICO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312376009	AYT.EOLICO/VAR BTA 20141125 E1 GTIA	25/11/2014	V	490,15
AYT FONDO EOLICO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312376017	AYT.EOLICO/VAR BTA 20161229 E2 GTIA	29/12/2016	V	490,00
AYT FTGENCAT I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0356848020	AYT.FTGENCAT I/VAR BTA 20340905 BG	05/09/2034	V	71.218,15
AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0307150015	AYT.GEN.H.IV/VAR BTH 20360516 B	16/05/2036	V	69.817,80
AYT GENOVA HIPOTECARIO VI, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0312349014	AYT.GEN.H.VI/VAR BTH 20380115 A2	15/01/2038	V	79.124,51
AYT GENOVA HIPOTECARIO XII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0312285002	AYT.GEN.H.XII/VAR BTH 20510315 A	15/03/2051	V	31.419,06
AYT HIPOTECARIO MIXTO IV, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0307152003	AYT.HIP.MIX.IV/VAR BTA 20400120 A	20/01/2040	V	48.352,10
AYT HIPOTECARIO MIXTO V, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312252002	AYT.HIP.MIX.V/VAR BTA 20410610 A	10/06/2041	V	57.387,31
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0307154017	KUTXA.HIP.II/VAR BTA 20561015 B	15/10/2056	V	59.116,33
AYT PRESTAMOS CONSUMO III, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312372016	AYT.PREST.C.III/VAR BTA 20210115 B	15/01/2021	V	78.871,29
AYT.11, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0338541008	AYT.11/VAR BTH 20351015 A GTIA	15/10/2035	V	26.821,50
AYT.11, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0338541016	AYT.11/VAR BTH 20351015 B GTIA	15/10/2035	V	68.997,04
BANCAJA 10, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312872015	BANCAJA10/VAR BTA 20500522 A2 GTIA	22/05/2050	V	69.670,82
BANCAJA 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312867007	BANCAJA.11/VAR BTA 20500427 A1 GTIA	27/01/2010	V	5.901,96
BANCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0312883004	BANCAJA.4/VAR BTH 20340618 A GTIA	18/06/2034	V	24.010,90
BANCAJA 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312885017	BANCAJA.6/VAR BTA 20360220 A2 GTIA	20/02/2036	V	28.710,91
BANCAJA 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312885025	BANCAJA.6/VAR BTA 20360220 B GTIA	20/02/2036	V	52.961,35
BANCAJA 8, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312887005	BANCAJA.8/VAR BTA 20371025 A GTIA	25/10/2037	V	39.875,39
BANCAJA 8, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312887013	BANCAJA.8/VAR BTA 20371025 B GTIA	25/10/2037	V	65.583,33
BANCAJA 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312888011	BANCAJA.9/VAR BTA 20430925 A2 GTIA	25/09/2043	V	49.301,10
BANCAJA 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312888029	BANCAJA.9/VAR BTA 20430925 B GTIA	25/09/2043	V	99.985,71
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211213	BBVA/VAR BO 20110622	22/06/2011	V	49.917,88
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211304	BBVA/5,00 BOSUBDCONV 20141015	15/10/2014	5,000	1.003,72
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0313377014	BCO.COOP.ESP/3,125 BO 20120402 GTIA	02/04/2012	3,125	51.221,06
BANCO COOPERATIVO ESPAÑOL, S.A.	ES0313377022	BCO.COOP.ESP/2,42 BO 20121015 GTIA	15/10/2012	2,420	50.000,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860092	SAB/VAR BO 20100920	20/09/2010	V	99.537,22
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860134	SAB/VAR BO 20111026	26/10/2011	V	98.573,72
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860175	SAB/VAR BOESTR 20110310	10/03/2011	V	42.972,47
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860233	SAB/4,375 BO 20120522	22/05/2012	4,375	103.718,19
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860241	SAB/VAR BOSUBDCONV 20130721	21/07/2013	V	969,30
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860258	SAB/VAR BO 20120220	20/02/2012	V	49.888,06
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0313980015	BVA/VAR BO 20110721	21/07/2011	V	47.008,19
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0313980023	BVA/VAR BO 20120223	23/02/2012	V	45.822,95
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0313580120	GUI/VAR BO 20110321	21/03/2011	V	97.268,98
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0313580138	GUI/2,375 BO 20121125 GTIA	30/11/2012	2,375	49.966,14
BANCO PASTOR, S.A.	ES0313770069	PAS/VAR BO 20100121	21/01/2010	V	99.986,79
BANCO PASTOR, S.A.	ES0313770077	PAS/3,00 BO 20120302 GTIA	02/03/2012	3,000	50.991,28
BANCO PASTOR, S.A.	ES0313770085	PAS/VAR BO 20121203 GTIA	03/12/2012	V	50.000,00
BANCO PASTOR, S.A.	ES0313770093	PAS/VAR BO 20111223 CREC	23/12/2011	V	100.000,00
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0313790000	POP/3,00 BO 20120223 GTIA	23/02/2012	3,000	51.121,86
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0313790026	POP/3,00 BO 20120424 GTIA	24/04/2012	3,000	50.948,46
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0313260053	BCH/VAR BO SUBD 201110527	27/05/2011	V	6,81
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0313540025	BBE/VAR BO 20100222	22/02/2010	V	99.943,41
BANKINTER 13 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313270029	BKT.13/VAR BTA 20490717 B GTIA	17/07/2049	V	67.139,62
BANKINTER 15 FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313272025	BKT.15/VAR BTH 20501020 A3 GTIA	20/10/2050	V	60.620,34
BANKINTER 2 PYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313716013	BKT.2.PYME/VAR BTA 20430516 A2 GTIA	16/05/2043	V	42.722,07
BANKINTER 4, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313919005	BKT.4/VAR BTH 20381112 A GTIA	12/11/2038	V	33.613,53
BANKINTER 4, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313919021	BKT.4/VAR BTH 20381112 C GTIA	12/11/2038	V	81.785,00
BANKINTER 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313814065	BKT.9/VAR BTA 20420716 BT GTIA	16/07/2042	V	81.482,56
BANKINTER, S.A.	ES0313679427	BKT/VAR BO 20101118	18/11/2010	V	99.596,29
BANKINTER, S.A.	ES0313679435	BKT/VAR BO 20110601	01/06/2011	V	99.080,55

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANKINTER, S.A.	ES0313679443	BKT/VAR BO 20120621	21/06/2012	V	97.647,83
BANKINTER, S.A.	ES0313679450	BKT/3.00 BO 20120224 GTIA	24/02/2012	3,000	102.049,68
BANKINTER, S.A.	ES0313679476	BKT/VAR BO 20120615 II GTIA	15/06/2012	V	727.026,80
BBVA CONSUMO 3 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313719009	BBVA.CONSUMO.3/VAR BTA 20220222 A	22/02/2022	V	52.134,75
BBVA CONSUMO 4 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313523005	BBVA.CONSUMO.4/VAR BTA 20230623 A	23/06/2023	V	99.985,42
BBVA CONSUMO 4 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313523013	BBVA.CONSUMO.4/VAR BTA 20230623 B	23/06/2023	V	99.978,47
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467175	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20140331 18	31/03/2014	V	52.040,62
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467308	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20141111 33	11/11/2014	V	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467316	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20121112 34	12/11/2012	V	49.200,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467324	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20141127 35	27/11/2014	V	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467332	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20121203 36	03/12/2012	V	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467340	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121207	07/12/2012	C	49.478,82
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467357	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121203	03/12/2012	C	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467365	BBVA.SR.FIN/5,00 BOESTR 20141201 39	01/12/2014	5,000	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467373	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121203	03/12/2012	C	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467381	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20121207 41	07/12/2012	V	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467399	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20141210 42	10/12/2014	V	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467407	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121210	10/12/2012	C	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467415	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121224	24/12/2012	C	49.416,67
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467423	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121214	14/12/2012	C	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467431	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121217	17/12/2012	C	49.625,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467449	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20121218 48	18/12/2012	V	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467464	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121217	17/12/2012	C	50.000,17
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467472	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20121224	24/12/2012	C	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467480	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20121224 52	24/12/2012	V	50.000,00
BBVA-3 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0310110020	BBVA3-PYME/VAR BTA 20280421 B GTIA	21/04/2028	V	37.980,37
BBVA-4 PYME, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370458012	BBVA4.PYME/VAR BTA 20380819 A2 GTIA	19/08/2038	V	18.491,04
BBVA-6 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370460000	BBVA6.PYME/VAR BTA 20460322 A1	22/03/2046	V	32.235,64
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080052	BPEF/VAR BO 20100526	26/05/2010	V	99.906,36
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080086	BPEF/VAR BO 20110118	18/01/2011	V	99.466,67
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080136	BPEF/VAR BO 20100728	28/07/2010	V	99.525,00
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080144	BPEF/VAR BO 20120208	08/02/2012	V	98.357,23
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080169	BPEF/VAR BO 20100726	26/07/2010	V	99.614,98
CABILDO INSULAR DE TENERIFE	ES0301330082	CBD0. TEN/0,75 BO 20121214	14/12/2012	0,750	1.000,00
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0314958010	CAIXANOVA/VAR BO 20101123	23/11/2010	V	97.556,35
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0314958028	CAIXANOVA/VAR BO 20110314	14/03/2011	V	49.468,85
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0314958036	CAIXANOVA/VAR BO 20120302	02/03/2012	V	48.830,00
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0314958044	CAIXANOVA/VAR BO 20110604	04/06/2011	V	50.775,00
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0314958051	CAIXANOVA/3,125 BO 20120319 GTIA	19/03/2012	3,125	51.126,99
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840077	CA.CATALUNYA/VAR BO 20100302	02/03/2010	V	99.940,31
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840101	CA.CATALUNYA/VAR BO 20110718	18/07/2011	V	97.649,56
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840143	CA.CATALUNYA/VAR BO 20100125	25/01/2010	V	49.967,77
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840168	CA.CATALUNYA/3,00 BO 20120305 GTIA	05/03/2012	3,000	50.969,70
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840176	CA.CATALUNYA/3,00 BO 20120507 GTIA	07/05/2012	3,000	51.019,80
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840184	CA.CATALUNYA/3,00 BO 20141029 GTIA	29/10/2014	3,000	49.863,21
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840192	CA.CATALUNYA/VAR BO 20141204 GTIA	04/12/2014	V	50.000,00
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0313249049	CA.GIRONA/3,09 BO 20120619 GTIA	19/06/2012	3,090	50.981,14
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0313249056	CA.GIRONA/2,512 BO 20121026 GTIA	26/10/2012	2,512	50.017,73
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0313249064	CA.GIRONA/VAR BO 20141214 GTIA	14/12/2014	V	50.000,00
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0314850035	CA.MANRESA/VAR BO 20110714	14/07/2011	V	97.450,00
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0314973084	CA.SABADELL/3,00 BO 20120604 GTIA	04/06/2012	3,000	50.803,00
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0314973100	CA.SABADELL/3,239 BO 20141113 GTIA	13/11/2014	3,239	50.000,00
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0314973118	CA.SABADELL/3,111 BO 20141127 GTIA	27/11/2014	3,111	50.000,00
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0315346009	CA.TARRAGONA/VAR BO 20110411	11/04/2011	V	97.980,00
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0315346025	CA.TARRAGONA/VAR BO 20111024 GTIA	24/10/2011	V	49.722,05
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0315346041	CA.TARRAGONA/VAR BO 20111204 GTIA	04/12/2011	V	50.595,00
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0315346058	CA.TARRAGONA/3,00 BO 20120615 GTIA	15/06/2012	3,000	50.813,00
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0314974041	CA.TERRASSA/VAR BO 20120605 GTIA	05/06/2012	V	50.944,53
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0314966062	CA.PENEDES/6,50 BO 20100721	21/07/2010	6,500	51.637,50
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0314966096	CA.PENEDES/1,796 BO 20100416 GTIA	16/04/2010	1,796	50.158,67
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0314966104	CA.PENEDES/1,85 BO 20100603 GTIA	03/06/2010	1,850	50.157,62
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0314966120	CA.PENEDES/VAR BO 20111118 GTIA	18/11/2011	V	49.843,36
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0314966161	CA.PENEDES/VAR BO 20120717 GTIA	17/07/2012	V	50.246,67
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0314846041	CA.LAIETANA/2,91 BO 20120605 GTIA	05/06/2012	2,910	50.714,50
CAIXA PENEDES 1 TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313252001	CA.PENEDES1.TDA/VAR BTA 20430128 A	28/01/2043	V	61.101,46
CAIXA PENEDES PYMES 1 TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACT	ES0357326000	PENEDES.PYMES.1/VAR BTA 20450928 A	28/09/2045	V	49.071,57
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0314826043	CAJASTUR/VAR BO 20121214 GTIA	14/12/2012	V	50.000,00
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0314826050	CAJASTUR/VAR BO 20121214 GTIA	14/12/2012	V	50.000,00
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0315424004	CCM/6,50 BO 20100624	24/06/2010	6,500	50.615,58
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843212	CAIXAGALICIA/VAR BO 20101129	29/11/2010	V	99.111,87
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843238	CAIXAGALICIA/VAR BO 20111108	08/11/2011	V	49.063,17
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843261	CAIXAGALICIA/VAR BO 20100110	10/01/2010	V	50.039,18
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843303	CAIXAGALICIA/3,25 BO 20120417 GTIA	17/04/2012	3,250	51.200,32
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843329	CAIXAGALICIA/3,00 BO 20141103 GTIA	03/11/2014	3,000	49.663,44
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES0315530032	CA.RIOJA/VAR BO 20100315	15/03/2010	V	96.265,79
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0314600083	CA.MURCIA/6,00 BO 20100604	04/06/2010	6,000	51.015,00
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0314600133	CA.MURCIA/VAR BO 20111017 GTIA	17/10/2011	V	50.437,83
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0314854086	CAJADUERO/2,451 BO 20121009 GTIA	09/10/2012	2,451	49.961,16
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0314975006	CA.CANTABRIA/VAR BO 20100406	06/04/2010	V	98.321,50
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0314975014	CA.CANTABRIA/VAR BO 20110330	30/03/2011	V	49.149,42
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977101	BANCAJA/3,95 BO 20110430	30/04/2011	3,950	600,17
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977119	BANCAJA/3,95 BO 20110601	01/06/2011	3,950	600,13
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977168	BANCAJA/VAR BO 20100110	10/01/2010	V	600,17
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977218	BANCAJA/VAR BO 20100225	25/02/2010	V	99.638,11
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977242	BANCAJA/VAR BO 20110510	10/05/2011	V	96.209,99

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977259	BANCAJAVAR BO 20120124	24/01/2012	V	92.947,96
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977267	BANCAJAVAR BO 20120321	21/03/2012	V	90.621,94
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977275	BANCAJA/3,00 BO 20120312 GTIA	12/03/2012	3,000	50.967,68
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977283	BANCAJAVAR BO 20120318 GTIA	18/03/2012	V	50.748,10
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977309	BANCAJAVAR BO 20110325 GTIA	25/03/2011	V	49.968,66
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977325	BANCAJA/3,00 BO 20120511 GTIA	11/05/2012	3,000	50.881,64
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977341	BANCAJA/2,375 BO 20120918 GTIA	18/09/2012	2,375	49.919,82
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0314977358	BANCAJA/3,00 BO 20141027 GTIA	27/10/2014	3,000	49.925,18
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES0315308173	CA.VITALVAR BO 20100331	31/03/2010	V	50.015,31
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES0315308181	CA.VITAL/1,838 BO 20100331 GTIA	31/03/2010	1,838	50.143,59
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES0315308199	CA.VITALVAR BO 20120323	23/03/2012	V	49.997,58
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES0315308207	CA.VITAL/2,479 BO 20120924 GTIA	24/09/2012	2,479	49.926,90
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400054	CAMVAR BO 20100114	14/01/2010	V	99.800,33
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400062	CAMVAR BO 20110203	03/02/2011	V	98.045,99
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400070	CAMVAR BO 20120515	15/05/2012	V	1.000,04
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400088	CAMVAR BO 20120412	12/04/2012	V	99.965,04
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400096	CAM/3,125 BO 20120326 GTIA	26/03/2012	3,125	51.182,92
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400104	CAM/3,25 BO 20120427 GTIA	27/04/2012	3,250	51.182,58
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400112	CAMVAR BO 20111108 GTIA	08/11/2011	V	49.821,70
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400120	CAM/2,875 BO 20120514 GTIA	14/05/2012	2,875	50.859,44
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400187	CAM/3,00 BO 20141112 GTIA	12/11/2014	3,000	49.844,78
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400195	CAMVAR BO 20141201 GTIA	01/12/2014	V	50.000,00
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES0314961063	CA.BURGOSVAR BO 20110131	31/01/2011	V	98.669,70
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0314910029	CA.AVILAVAR BO 20100629	29/06/2010	V	49.915,10
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0314910037	CA.AVILAVAR BO 20101029	29/10/2010	V	50.209,81
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0314910045	CA.AVILAVAR BO 20120430 GTIA	30/04/2012	V	50.694,09
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0314910060	CA.AVILAVAR BO 20120409 CREC	09/04/2012	V	50.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0314910078	CA.AVILAVAR BO 20111009	09/10/2011	V	50.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0364730004	CAJASURVAR BO 20100118	18/01/2010	V	50.009,85
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES0314926009	SA.NOSTRA/6,50 BO 20100728	28/07/2010	6,500	51.602,50
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES0314926025	SA.NOSTRA/3,00 BO 20141210 GTIA	10/12/2014	3,000	49.979,08
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950074	CA.MADRID/4,9089 BO SUBD 20100406	06/04/2010	4,909	603,07
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950215	CA.MADRIDVAR BO 20100323	23/03/2010	V	99.869,92
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950280	CA.MADRIDVAR BO 20100524	24/05/2010	V	99.838,28
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950348	CA.MADRID/5,125 BO 20110411	11/04/2011	5,125	51.934,11
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950363	CA.MADRIDVAR BO 20100625	25/06/2010	V	50.020,70
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950371	CA.MADRIDVAR BOESTR 20100728	28/07/2010	V	43.266,59
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950389	CA.MADRIDVAR BOESTR 20100802	02/08/2010	V	43.426,70
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950397	CA.MADRIDVAR BO 20101015 CREC	15/10/2010	V	49.997,81
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950447	CA.MADRID/3,65 BO 20100728	28/07/2010	3,650	50.680,91
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950454	CA.MADRID/3,125 BO 20120220 GTIA	20/02/2012	3,125	51.237,88
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950470	CA.MADRID/2,875 BO 20120416 GTIA	16/04/2012	2,875	50.833,34
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950488	CA.MADRID/3,245 BO 20101008	08/10/2010	3,245	50.674,04
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950504	CA.MADRID/3,00 BO 20101022	22/10/2010	3,000	50.564,84
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950520	CA.MADRID/2,65 BO 20101108	08/11/2010	2,650	50.400,79
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950538	CA.MADRID/3,625 BO 20110629 GTIA	29/06/2011	3,625	50.983,70
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950546	CA.MADRIDVAR BO 20111123 CREC	23/11/2011	V	50.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0314965007	CAN/5,75 BO 20100527	27/05/2010	5,750	101.631,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0314965031	CANVAR BO 20110310 GTIA	10/03/2011	V	50.260,41
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0314959042	CA.SEGOVIA/2,595 BO 20110518 GTIA	18/05/2011	2,595	50.691,83
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0314959059	CA.SEGOVIAVAR BO 20110518 GTIA	18/05/2011	V	49.843,36
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0314959075	CA.SEGOVIA/2,50 BO 20121026 GTIA	26/10/2012	2,500	49.960,45
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO CATOLIC	ES0315134009	CAJACIRCULOVAR BO 20120308	08/03/2012	V	48.575,38
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0314970098	LACAIXA/3,375 BO 20120203 GTIA	03/02/2012	3,375	51.530,62
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0315474405	CA.ESPAÑAVAR BO 20100330	30/03/2010	V	998,21
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0315474421	CA.ESPAÑAVAR BO 20101214	14/12/2010	V	96.585,98
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0315474447	CA.ESPAÑAVAR BO 20121122	22/11/2012	V	943,08
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE D	ES0315474454	CA.ESPAÑA/3,004 BO 20120615 GTIA	15/06/2012	3,004	50.818,00
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0314981053	CAJACANARIASVAR BO 20120316 GTIA	16/03/2012	V	50.811,42
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES0314982002	CA.GRANADAVAR BO 20120308	08/03/2012	V	48.625,00
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES0314982010	CA.GRANADA/6,625 BO 20100714	14/07/2010	6,625	51.637,50
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0314983026	LA.CAJAVAR BO 20100915	15/09/2010	V	49.153,48
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0314983059	LA.CAJA/3,159 BO 20110518 GTIA	18/05/2011	V	50.400,17
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0314983091	LA.CAJA/3,159 BO 20140509 GTIA	09/05/2014	3,159	49.975,20
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0314601016	CAJAMARVAR BO 20110714	14/07/2011	V	49.951,54
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0314601024	CAJAMAR/3,125 BO 20120330 GTIA	30/03/2012	3,125	51.091,00
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0314601032	CAJAMARVAR BO 20110331 GTIA	31/03/2011	V	49.976,63
CAP-TDA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0315911000	CAP-TDA.1/VAR BTA 20130912 GTIA	12/09/2013	V	96.520,90
CEAMI GUARANTEED BONDS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACT	ES0315944001	CEAMI.BONDS.I/3,125 BTA 20120622	22/06/2012	3,125	51.044,70
CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 2, FONDO DE TITULIZACION	ES0318821008	CED.POP.2/3,75 BTA 20110412 GTIA	12/04/2011	3,750	102.383,29
CEDULAS GRUPO BANCO POPULAR 3, FONDO DE TITULIZACION	ES0318822006	CED.POP.3/4,25 BTA 20170426 GTIA	26/04/2017	4,250	100.248,48
CEDULAS TDA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0317018002	CED.TDA.1/3,25 BTA 20100619 1 GTIA	19/06/2010	3,250	100.998,10
CEDULAS TDA 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0318824002	CED.TDA.11/VAR BTA 20120601 A GTIA	01/06/2010	V	40.000,00
CEDULAS TDA 14, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0318827005	CED.TDA.14/3,25 BTA 20130715 A1	15/07/2013	3,250	32.078,84
CEDULAS TDA 15, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0318828003	CED.TDA.15/3,25 BTA 20130603 GTIA	03/06/2013	3,250	47.516,97
CEDULAS TDA 17, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0316989005	CED.TDA.17/3,125 BTA 20130923 A	23/09/2013	3,125	50.000,00
CEDULAS TDA 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0317019000	CED.TDA.2/4,50 BTA 20131126 GTIA	26/11/2013	4,500	104.247,34
CEDULAS TDA 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0317043000	CED.TDA.3/4,38 BTA 20160303 1 GTIA	03/03/2016	4,375	101.234,18
CEDULAS TDA 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0317045005	CED.TDA.5/4,13 BTA 20191129 A GTIA	29/11/2019	4,125	93.680,82
CEDULAS TDA 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0317047001	CED.TDA.7/3,50 BTA 20170620 GTIA	20/06/2017	3,500	94.486,75
CONSUMO BANCAJA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0323633000	CONS.BANCAJA.1/VAR BTA 20200526 A	26/05/2020	V	34.320,91
CRITERIA CAIXACORP, S.A.	ES0340609009	CRI/4,125 BO 20141120	20/11/2014	4,125	49.815,84
EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 3, FONDO DE TITULIZACION	ES0330876014	TDA.CAM.3/VAR BTA 20400128 A2 GTIA	28/01/2040	V	64.463,72
ENAGAS, S.A.	ES0330960008	ENG/3,25 BO 20120706	06/07/2012	3,250	51.293,08
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0330991003	ELE.CAPVAR BO 20120705	05/07/2012	V	49.623,88

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
ENTE PUBLICO RTVE	ES0331163107	RTVE/VAR BO 20100429	29/04/2010	V	199.959,15
F.T.A. PROGRAMA INDEPENDIENTE DE TITULIZ. DE CED. HIPOTE	ES0334699008	PRG.IND.CED.HIP/5, 125 BTA 20220720	20/07/2022	5,125	99.912,96
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER AUTO 1	ES0382040006	SAN.AUTO1/VAR BTA 20211125 GTIA	25/11/2021	V	11.364,57
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER CONSUMER	ES0338057005	SAN.CON.S.AUT006/VAR BTA 20161020 A	20/10/2016	V	41.800,60
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER CONSUMER	ES0337709002	SAN.AUTO.07-1/VAR BTA 20220920 A	20/09/2022	V	54.216,49
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER EMPRESAS ;	ES0338058045	SAN.EMPR.2/VAR BTA 20500623 D GTIA	23/06/2050	V	63.959,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER FINANCIACI	ES0382043000	SAN.FINAN.1/VAR BTA 20350720 A GTIA	20/07/2035	V	29.290,24
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIPOTECARI	ES0382042002	SAN.HIP.2/VAR BTA 20490118 A GTIA	18/01/2049	V	54.786,56
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIPOTECARI	ES0338093026	SAN.HIP.3/VAR BTA 20500118 A3 GTIA	18/01/2050	V	84.203,57
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS SANTANDER HIPOTECARI	ES0338093067	SAN.HIP.3/VAR BTA 20500118 E GTIA	18/01/2050	V	99.725,33
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 11	ES0338340005	UCI.11/VAR BTA 20410915 A GTIA	15/09/2041	V	27.281,31
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 11	ES0338340021	UCI.11/VAR BTA 20410915 C GTIA	15/09/2041	V	68.300,00
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 14	ES0338341003	UCI.14/VAR BTA 20430620 A GTIA	20/06/2043	V	39.628,15
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 16	ES0338186010	UCI.16/VAR BTA 20490616 A2 GTIA	16/06/2049	V	64.303,40
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 18	ES0337986006	UCI.18/VAR BTA 20501216 A GTIA	16/12/2050	V	56.054,72
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 8	ES0338446000	UCI.8/VAR BTA 20331218 A GTIA	18/12/2033	V	15.711,15
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 9	ES0338222005	UCI.9/VAR BTA 20350619 A GTIA	19/06/2035	V	19.293,57
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, HIPOTEBANSA 11	ES0338447008	HIPOTEBANSA.11/VAR BTA 20350215 A	15/02/2035	V	27.969,69
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, SANTANDER EMPRESAS	ES0337710018	SAN.EMPR.3/VAR BTA 20491016 A2 GTIA	16/10/2049	V	47.165,15
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, UCI 15	ES0380957003	UCI.15/VAR BTA 20481218 A GTIA	18/12/2048	V	46.259,69
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, UCI 17	ES0337985016	UCI.17/VAR BTA 20491217 A2 GTIA	17/12/2049	V	60.000,00
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 10	ES0338146006	UCI.10/VAR BTH 20360622 A GTIA	22/06/2036	V	27.573,15
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 12	ES0338147004	UCI.12/VAR BTH 20391215 A GTIA	15/12/2039	V	32.871,48
FTPYME BANCAJA 3 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0304501044	PYME.BANCAJA.3/VAR BTA 20371213 C	13/12/2037	V	42.659,11
FTPYME BANCAJA 4 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339731020	PYME.BANCAJA.4/VAR BTA 20380724 A3G	24/07/2038	V	35.533,73
FTPYME BANCAJA 4 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339731038	PYME.BANCAJA.4/VAR BTA 20380724 B	24/07/2038	V	87.000,00
FTPYME BANCAJA 4 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339731053	PYME.BANCAJA.4/VAR BTA 20380724 D	24/07/2038	V	99.854,41
FTPYME TDA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339752000	FTPYME.TDA.4/VAR BTA 20350726 1SA	26/07/2035	V	4.249,07
FTPYME TDA 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339741011	FTPYME.TDA.5/VAR BTA 20371026 2CA	26/10/2037	V	85.026,10
FTPYME TDA BANCA MARCH, FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0339753016	PYME.TDA.MARCH/VAR BTA 20360926 2CA	26/09/2036	V	52.024,99
FTPYME TDA CAM 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339758007	PYME.TDA.CAM.2/VAR BTA 20420726 1SA	26/07/2042	V	3.885,00
FTPYME TDA CAM 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339759013	PYME.TDA.CAM.4/VAR BTA 20450928 A2	28/09/2045	V	39.904,97
FTPYME TDA SABADELL 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0339844013	PYME.TDA.SAB.2/VAR BTA 20230126 1SA	26/01/2023	V	21.730,58
GAT FTGENCAT 2007, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0341081018	GAT.GENCAT.07/VAR BTA 20491215 A2G	15/12/2049	V	99.773,00
GAT FTGENCAT 2007, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0341081026	GAT.GENCAT.07/VAR BTA 20491215 B	15/12/2049	V	71.058,00
GAT FTGENCAT 2008, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0341071027	GAT.GENCAT.08/VAR BTA 20480128 B	28/01/2048	V	67.089,00
GAT FTGENCAT 2009, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0341064006	GAT.GENCAT.09/VAR BTA 20470120 A1G	20/01/2047	V	100.000,00
GC FTPYME PASTOR 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0316873001	GC.PYME.PAS.1/VAR BTA 20231015 AS	15/10/2023	V	2.948,15
GC FTPYME SABADELL 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0341169003	GC.PYME.SAB.4/VAR BTA 20380430 AS	30/04/2038	V	10.546,81
GC PASTOR HIPOTECARIO 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTI	ES0332235011	GC.PAS.HIP.5/VAR BTA 20460630 A2	30/06/2046	V	85.597,70
HIPOCAT 10, F.T.A.	ES0345671038	HIPOCAT 10/VAR BTA 20120424 A4 GTIA	24/04/2012	V	90.891,84
HIPOCAT 14, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345674016	HIPOCAT.14/VAR BTA 20501215 B GTIA	15/12/2050	V	68.239,36
HIPOCAT 16, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345676011	HIPOCAT.16/VAR BTA 20510315 B GTIA	15/03/2051	V	61.853,22
HIPOCAT 17, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345677001	HIPOCAT.17/VAR BTA 20520920 A GTIA	20/09/2052	V	85.587,69
HIPOCAT 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345721015	HIPOCAT.9/VAR BTA 20380715 A2A GTIA	15/07/2038	V	69.962,96
HIPOCAT 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345721023	HIPOCAT.9/VAR BTA 20380715 A2B GTIA	15/07/2038	V	62.194,40
HIPOCAT 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345721049	HIPOCAT.9/VAR BTA 20380715 C GTIA	15/07/2038	V	76.774,78
IM CAJA LABORAL 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347552004	IM.CA.LABORAL.2/VAR BTA 20510124 A	24/01/2051	V	91.033,37
IM CEDULAS 1 GRUPO BANCO POPULAR, FONDO DE TITULIZACI	ES0347858005	IM.CEDULAS 1/4,25 BTA 20140212 GTIA	12/02/2014	4,250	101.865,91
IM CEDULAS 10, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0349045007	IM.CED.10/4,50 BTA 20220221 GTIA	21/02/2022	4,500	94.739,95
IM CEDULAS 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347852008	IM.CED.3/4,00 BTA 20141119 GTIA	19/11/2014	4,000	100.640,96
IM CEDULAS 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347848006	IM.CED.4/3,75 BTA 20150311 A GTIA	11/03/2015	3,750	99.360,07
IM CEDULAS 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347784003	IM.CED.7/4,00 BTA 20210331 GTIA	31/03/2021	4,000	91.814,58
IM CEDULAS 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347785000	IM.CED.9/4,25 BTA 20160809 GTIA	09/08/2016	4,250	100.071,35
IM FTGENCAT SABADELL 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0347842017	IM.GENCAT.SAB.2/VAR BTA 20281116 AG	16/11/2028	V	99.896,00
IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, FONDO DE TITULIZAC	ES0347843049	IM.POP.EMP.1/VAR BTA 20330321 D	21/03/2033	V	67.879,54
IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I FONDO DE TITULIZACION	ES0347844070	IM.POP.PYME.I/VAR BTA 20390921 D	21/09/2039	V	77.502,31
IM PASTOR 3, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0347862007	IM.PAS.3/VAR BTH 20430322 A GTIA	22/03/2043	V	36.345,78
IM PASTOR 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347854004	IM.PAS.4/VAR BTA 20440322 A GTIA	22/03/2044	V	44.744,62
IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0347787014	IM.PREST.F.CED./VAR BTA 20220124 B	24/01/2022	V	58.864,26
IM TERRASSA 1 FTGENCAT FTA	ES0347863039	IM.TERR.1/VAR BTA 20500424 C GTIA	24/04/2050	V	91.587,15
IM TERRASSA 1 FTGENCAT FTA	ES0347863047	IM.TERR.1/VAR BTA 20500424 D GTIA	24/04/2050	V	91.586,24
IM TERRASSA MBS 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347855001	IM.TERR.MBS.1/VAR BTA 20490724 A	24/07/2049	V	47.388,07
INTERMONEY MASTER CEDULAS, FONDO DE TITULIZACION DE A	ES0362859003	INTER.MAST.CED/3,50 BTA 20151202 M1	02/12/2015	3,500	96.733,77
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE CREDIT	ES0317617027	LICO.LEASING/2,656 BO 20121126 GTIA	26/11/2012	2,656	50.000,00
MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359092014	MADRID.RMBS.II/VAR BTA 20490822 A2	22/08/2049	V	47.868,93
MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359092030	MADRID.RMBS.II/VAR BTA 20490822 B	22/08/2049	V	47.297,06
MADRID RMBS II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359092048	MADRID.RMBS.II/VAR BTA 20490822 C	22/08/2049	V	41.982,81
MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359093012	MADRID.RMBS.III/VAR BTA 20500222 A2	22/02/2050	V	73.516,13
MBS BANCAJA 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361795000	MBS.BANCAJA.2/VAR BTA 20380225 A	25/02/2038	V	35.481,38
MBS BANCAJA 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361796016	MBS.BANCAJA.3/VAR BTA 20431226 A2	26/12/2043	V	51.563,24
MBS BANCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361797014	MBS.BANCAJA.4/VAR BTA 20500723 A2	23/07/2050	V	59.270,91
MBS BANCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361797048	MBS.BANCAJA.4/VAR BTA 20500723 C	23/07/2050	V	64.000,00
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANDO DE HU	ES0358197012	CAJASOL/3,125 BO 20120427 GTIA	27/04/2012	3,125	51.103,40
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES0364872087	UNICAJA/5,375 BO 20100521	21/05/2010	5,375	51.150,00
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES0364872095	UNICAJA/3,00 BO 20120618 GTIA	18/06/2012	3,000	50.957,92
POPULAR CAPITAL, S.A.	ES0370412001	POP.CAP./VAR BOSUBDCANJ 20131023	23/10/2013	V	978,86
PROGRAMA CEDULAS TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0371622004	PROG.CED.TDA/VAR BTA 20160408 A1	08/04/2016	V	91.000,00
PROGRAMA CEDULAS TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0371622012	PROG.CED.TDA/4,13 BTA 201210410 A4	10/04/2021	4,125	93.334,00
PROGRAMA CEDULAS TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0371622020	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20310410 A6	10/04/2031	4,250	84.467,86
PROGRAMA CEDULAS TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0371622046	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20270328 A5	28/03/2027	4,250	86.802,00
PYME BANCAJA 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0372259038	PYME.BANCAJA.5/VAR BTA 20390214 B	14/02/2039	V	63.000,00
PYME VALENCIA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0372241010	PYME.VALENCIA1/VAR BTA 20400323 A2	23/03/2040	V	43.585,70
PYMES BANESTO 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0372260010	PYMES.BTO.2/VAR BTA 20311231 A2	31/12/2031	V	83.204,22
RURAL HIPOTECARIO GLOBAL I, FTA	ES0374273003	RURAL.HIP.GBL.I/VAR BTA 20390118 A	18/01/2039	V	44.590,63

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

CÉDULAS

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211014	BBVA/5,75 CEDHIP 20100927 GTIA	27/09/2010	5,750	104.429,97
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211030	BBVA/4,25 CEDHIP 20130129 GTIA	29/01/2013	4,250	105.376,31
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211048	BBVA/3,50 CEDHIP 20110315 GTIA	15/03/2011	3,500	102.685,59
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211055	BBVA/4,25 CEDHIP 20140715 GTIA	15/07/2014	4,250	105.942,05
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211071	BBVA/4,00 CEDHIP 20250225 GTIA	25/02/2025	4,000	94.824,15
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211097	BBVA/2,75 CEDHIP 20100607 GTIA	07/06/2010	2,750	100.959,68
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211105	BBVA/3,50 CEDHIP 20201007 GTIA	07/10/2020	3,500	96.432,55
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211113	BBVA/3,25 CEDHIP 20160124 GTIA	24/01/2016	3,250	99.174,76
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211121	BBVA/3,50 CEDHIP 20210124 GTIA	24/01/2021	3,500	93.935,72
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211139	BBVA/3,875 CEDHIP 20120531 GTIA	31/05/2012	3,875	103.999,66
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211154	BBVA/3,75 CEDHIP 20131004 GTIA	04/10/2013	3,750	103.312,72
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211162	BBVA/3,75 CEDTER 20111123 GTIA	23/11/2011	3,750	103.741,65
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211170	BBVA/4,25 CEDHIP 20170118 GTIA	18/01/2017	4,250	104.310,64
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211204	BBVA/4,50 CEDTER 20140530 GTIA	30/05/2014	4,500	53.333,27
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211261	BBVA/4,625 CEDTER 20120802 GTIA	02/08/2012	4,625	106.062,50
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211337	BBVA/3,00 CEDHIP 20141009 GTIA	09/10/2014	3,000	49.873,03
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0400230001	BCO.CTO.LOCAL/3,75 CEDTER 20100407	07/04/2010	3,750	101.180,58
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0400230068	BCO.CTO.LOCAL/3,75 CEDTER 20111020	20/10/2011	3,750	103.523,04
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860000	SAB/4,50 CEDHIP 20130429 GTIA	29/04/2013	4,500	105.557,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860018	SAB/3,75 CEDHIP 20110126 GTIA	26/01/2011	3,750	102.503,75
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860026	SAB/3,25 CEDHIP 20150615 GTIA	15/06/2015	3,250	98.576,07
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860034	SAB/3,50 CEDHIP 20160119 GTIA	19/01/2016	3,500	99.238,71
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860067	SAB/4,25 CEDHIP 20170124 GTIA	24/01/2017	4,250	102.516,32
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860109	SAB/5,00 CEDHIP 20100509 GTIA	09/05/2010	5,000	101.982,65
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440027	BTO/5,75 CEDHIP 20170327 GTIA	27/03/2017	5,750	113.736,36
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440035	BTO/4,00 CEDHIP 20100512 GTIA	12/05/2010	4,000	101.388,93
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440043	BTO/3,75 CEDHIP 20110223 GTIA	23/02/2011	3,750	102.790,72
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440050	BTO/4,25 CEDHIP 20140916 GTIA	16/09/2014	4,250	105.279,34
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440068	BTO/3,50 CEDHIP 20150127 GTIA	27/01/2015	3,500	101.008,96
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440076	BTO/2,75 CEDHIP 20120907 GTIA	07/09/2012	2,750	100.887,32
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440084	BTO/3,50 CEDHIP 20160118 GTIA	18/01/2016	3,500	100.658,89
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440092	BTO/4,25 CEDHIP 20130712 GTIA	12/07/2013	4,250	105.470,00
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440100	BTO/4,25 CEDHIP 20140221 GTIA	21/02/2014	4,250	105.616,18
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440159	BTO/3,625 CEDHIP 20130604 GTIA	04/06/2013	3,625	103.090,76
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440167	BTO/2,625 CEDHIP 20130228 GTIA	28/02/2013	2,625	49.944,14
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770001	PAS/3,75 CEDHIP 20150304 GTIA	04/03/2015	3,750	100.675,00
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770019	PAS/3,875 CEDHIP 20130920 GTIA	20/09/2013	3,875	102.862,04
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770050	PAS/6,00 CEDHIP 20100621 GTIA	21/06/2010	6,000	102.419,29
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770092	PAS/3,25 CEDHIP 20140317 GTIA	17/03/2014	3,250	99.728,41
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790009	POP/3,00 CEDHIP 20121018 GTIA	18/10/2012	3,000	100.950,79
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790017	POP/4,00 CEDHIP 20161018 GTIA	18/10/2016	4,000	102.159,95
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790058	POP/4,375 CEDHIP 20140616 GTIA	16/06/2014	4,375	52.735,77
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900020	SAN/4,00 CEDTER 20130708 GTIA	08/07/2013	4,000	104.680,00
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900038	SAN/4,00 CEDHIP 20100910 GTIA	10/09/2010	4,000	102.439,45
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900061	SAN/4,50 CEDHIP 20160729 GTIA	29/07/2016	4,500	105.824,52
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900079	SAN/3,25 CEDHIP 20120207 GTIA	07/02/2012	3,250	102.725,02
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900087	SAN/4,00 CEDHIP 20200407 GTIA	07/04/2020	4,000	99.793,75
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900095	SAN/2,50 CEDHIP 20110128 GTIA	28/01/2011	2,500	101.416,48
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900103	SAN/3,125 CEDHIP 20150928 GTIA	28/09/2015	3,125	99.144,27
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900111	SAN/3,50 CEDHIP 20140206 GTIA	06/02/2014	3,500	102.389,73
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900129	SAN/3,875 CEDHIP 20260206 GTIA	06/02/2026	3,875	92.423,96
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900137	SAN/3,75 CEDHIP 20110908 GTIA	08/09/2011	3,750	103.478,91
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900145	SAN/4,125 CEDHIP 20170109 GTIA	09/01/2017	4,125	103.271,18
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900152	SAN/4,25 CEDHIP 20130506 GTIA	06/05/2013	4,250	105.487,03
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900160	SAN/4,625 CEDHIP 20270504 GTIA	04/05/2027	4,625	102.155,64
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900178	SAN/4,50 CEDHIP 20121114 GTIA	14/11/2012	4,500	105.742,37
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900186	SAN/3,875 CEDHIP 20140527 GTIA	27/05/2014	3,875	103.951,40
BANKINTER, S.A.	ES0413679020	BKT/5,00 CEDHIP 20100514 GTIA	14/05/2010	5,000	50.968,55
BANKINTER, S.A.	ES0413679061	BKT/3,25 CEDHIP 20141113 GTIA	13/11/2014	3,250	99.459,45
BILBAO BIZKAIA KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA	ES0414100026	BBK/3,375 CEDHIP 20140929 GTIA	29/09/2014	3,375	100.294,75
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0414840274	CA.CATALUNYA/3,50 CEDHIP 20160307	07/03/2016	3,500	96.150,00
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0414840308	CA.CATALUNYA/4,875 CEDHIP 20170629	29/06/2017	4,875	102.597,28
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0414840381	CA.CATALUNYA/5,00 CEDHIP 20100519	19/05/2010	5,000	101.991,35
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0414826059	CAJASTUR/3,00 CEDHIP 20130628 GTIA	28/06/2013	3,000	49.767,05
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0414843146	CAIXAGALICIA/4,375 CEDHIP 20190123	23/01/2019	4,375	96.825,27
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0414843179	CAIXAGALICIA/5,25 CEDHIP 20100526	26/05/2010	5,250	51.126,73
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0414854036	CAJADUERO/VAR CEDHIP 20120629 GTIA	29/06/2012	V	999,56
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0414854044	CAJADUERO/VAR CEDHIP 20120929 GTIA	29/09/2012	V	999,07
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0414854051	CAJADUERO/6,50 CEDHIP 20100629 GTIA	29/06/2010	6,500	999,48
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0414854077	CAJADUERO/2,847 CEDHIP 20130628	28/06/2013	2,847	50.000,00
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0414977274	BANCAJA/5,00 CEDHIP 20100519 GTIA	19/05/2010	5,000	102.129,03
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0414400038	CAM/6,125 CEDHIP 20100625 GTIA	25/06/2010	6,125	102.993,78
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0414400079	CAM/3,375 CEDHIP 20141022 GTIA	22/10/2014	3,375	49.740,65
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0464730094	CAJASUR/VAR CEDHIP 20141124 GTIA	24/11/2014	V	100.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950552	CA.MADRID/5,50 CEDHIP 20100115 GTIA	15/01/2010	5,500	101.024,61
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950560	CA.MADRID/5,75 CEDHIP 20160629 GTIA	29/06/2016	5,750	111.340,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950586	CA.MADRID/5,25 CEDHIP 20120301 GTIA	01/03/2012	5,250	106.584,52
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950594	CA.MADRID/5,00 CEDHIP 20141030 GTIA	30/10/2014	5,000	107.930,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950610	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20110325 GTIA	25/03/2011	3,500	102.331,98
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950628	CA.MADRID/4,00 CEDHIP 20250203 GTIA	03/02/2025	4,000	92.723,03
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950636	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20151214 GTIA	14/12/2015	3,500	99.549,59
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950644	CA.MADRID/4,125 CEDHIP 20360324	24/03/2036	4,125	44.641,78
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950651	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20180525 GTIA	25/05/2018	4,250	50.213,15
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950669	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20160705 GTIA	05/07/2016	4,250	51.487,78
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950677	CA.MADRID/4,25 CEDTER 20140221 GTIA	21/02/2014	4,250	52.438,37

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

PAGARÉS

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

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806390	POP/PAG 20101203	03/12/2010	C	987,67
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806416	POP/PAG 20100112	12/01/2010	C	999,64
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513806473	POP/PAG 20101210	10/12/2010	C	987,86
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540013	BBE/PAG 20100616	16/06/2010	C	994,07
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135400M5	BBE/PAG 20100113	13/01/2010	C	999,29
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135400N3	BBE/PAG 20100514	14/05/2010	C	994,99
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135400R4	BBE/PAG 20100118	18/01/2010	C	999,55
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135400T0	BBE/PAG 20100128	28/01/2010	C	998,74
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135400U8	BBE/PAG 20100201	01/02/2010	C	998,03
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135400X2	BBE/PAG 20100215	15/02/2010	C	998,12
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135400Y0	BBE/PAG 20100305	05/03/2010	C	998,05
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135400Z7	BBE/PAG 20100310	10/03/2010	C	995,51
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401B6	BBE/PAG 20100315	15/03/2010	C	996,79
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401G5	BBE/PAG 20100330	30/03/2010	C	994,76
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401H3	BBE/PAG 20100528	28/05/2010	C	992,57
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401I1	BBE/PAG 20100826	26/08/2010	C	988,85
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401L5	BBE/PAG 20100419	19/04/2010	C	994,78
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401O9	BBE/PAG 20101028	28/10/2010	C	987,38
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401P6	BBE/PAG 20100209	09/02/2010	C	998,13
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401Q4	BBE/PAG 20100519	19/05/2010	C	994,89
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401R2	BBE/PAG 20100223	23/02/2010	C	998,12
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401S0	BBE/PAG 20100524	24/05/2010	C	994,93
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401V4	BBE/PAG 20100531	31/05/2010	C	994,85
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401W2	BBE/PAG 20100830	30/08/2010	C	991,32
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401X0	BBE/PAG 20100104	04/01/2010	C	999,58
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135401Y8	BBE/PAG 20100120	20/01/2010	C	999,53
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135402A6	BBE/PAG 20100111	11/01/2010	C	999,55
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135402B4	BBE/PAG 20100615	15/06/2010	C	994,84
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES05135407B3	BBE/PAG 20100108	08/01/2010	C	998,34
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540999	BBE/PAG 20100505	05/05/2010	C	994,79
BANKINTER, S.A.	ES0513679LX0	BKT/PAG 20100120	20/01/2010	C	999,64
BANKINTER, S.A.	ES0513679MN9	BKT/PAG 20100420	20/04/2010	C	995,21
BANKINTER, S.A.	ES0513679MS8	BKT/PAG 20100319	19/03/2010	C	998,10
BANKINTER, S.A.	ES0513679NJ5	BKT/PAG 20100219	19/02/2010	C	997,97
BANKINTER, S.A.	ES0513679NT4	BKT/PAG 20100401	01/04/2010	C	998,05
BANKINTER, S.A.	ES0513679NW8	BKT/PAG 20100428	28/04/2010	C	996,73
BANKINTER, S.A.	ES0513679NZ1	BKT/PAG 20100507	07/05/2010	C	994,96
BANKINTER, S.A.	ES0513679OA2	BKT/PAG 20100520	20/05/2010	C	995,15
BANKINTER, S.A.	ES0513679OE4	BKT/PAG 20100618	18/06/2010	C	994,86
BANKINTER, S.A.	ES0513679OF1	BKT/PAG 20100111	11/01/2010	C	998,88
BANKINTER, S.A.	ES0513679OG9	BKT/PAG 20100610	10/06/2010	C	995,08
BANKINTER, S.A.	ES0513679OL9	BKT/PAG 20100730	30/07/2010	C	993,79
BANKINTER, S.A.	ES0513679OM7	BKT/PAG 20100201	01/02/2010	C	999,04
BANKINTER, S.A.	ES0513679ON5	BKT/PAG 20100820	20/08/2010	C	988,66
BANKINTER, S.A.	ES0513679OO3	BKT/PAG 20100301	01/03/2010	C	998,16
BANKINTER, S.A.	ES0513679OQ8	BKT/PAG 20100920	20/09/2010	C	991,28
BANKINTER, S.A.	ES0513679OT2	BKT/PAG 20100326	26/03/2010	C	998,25
BANKINTER, S.A.	ES0513679OV8	BKT/PAG 20100412	12/04/2010	C	995,07
BANKINTER, S.A.	ES0513679OW6	BKT/PAG 20101012	12/10/2010	C	989,74
BANKINTER, S.A.	ES0513679OY2	BKT/PAG 20101028	28/10/2010	C	988,14
BANKINTER, S.A.	ES0513679PA9	BKT/PAG 20100531	31/05/2010	C	994,96
BANKINTER, S.A.	ES0513679PB7	BKT/PAG 20101206	06/12/2010	C	988,32
BANKINTER, S.A.	ES0513679PC5	BKT/PAG 20101214	14/12/2010	C	988,09
BARCLAYS BANK, S.A.	ES0513985D57	BARCLAYS/PAG 20100604	04/06/2010	C	991,80
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424126	BBK.EMPTOS/PAG 20100202	02/02/2010	C	998,19
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134242F6	BBK.EMPTOS/PAG 20100126	26/01/2010	C	999,08
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134242G4	BBK.EMPTOS/PAG 20100311	11/03/2010	C	998,41
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134242K6	BBK.EMPTOS/PAG 20100326	26/03/2010	C	998,19
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134242R1	BBK.EMPTOS/PAG 20100108	08/01/2010	C	998,11
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134242Y7	BBK.EMPTOS/PAG 20100507	07/05/2010	C	995,66
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134243E7	BBK.EMPTOS/PAG 20101119	19/11/2010	C	988,89
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134243H0	BBK.EMPTOS/PAG 20100528	28/05/2010	C	995,11
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134243U3	BBK.EMPTOS/PAG 20100714	14/07/2010	C	991,44
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134243V1	BBK.EMPTOS/PAG 20100723	23/07/2010	C	992,71
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244F2	BBK.EMPTOS/PAG 20100210	10/02/2010	C	997,40
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244J4	BBK.EMPTOS/PAG 20100903	03/09/2010	C	988,80
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244M8	BBK.EMPTOS/PAG 20100316	16/03/2010	C	998,19
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244N6	BBK.EMPTOS/PAG 20100330	30/03/2010	C	996,04
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244O4	BBK.EMPTOS/PAG 20100930	30/09/2010	C	987,73
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244P1	BBK.EMPTOS/PAG 20100104	04/01/2010	C	998,88
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244Q9	BBK.EMPTOS/PAG 20100315	15/03/2010	C	996,89
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244R7	BBK.EMPTOS/PAG 20100419	19/04/2010	C	994,68
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244S5	BBK.EMPTOS/PAG 20101006	06/10/2010	C	987,72
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244T3	BBK.EMPTOS/PAG 20100115	15/01/2010	C	998,88
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244U1	BBK.EMPTOS/PAG 20101014	14/10/2010	C	987,78
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244V9	BBK.EMPTOS/PAG 20100129	29/01/2010	C	998,94
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244W7	BBK.EMPTOS/PAG 20101028	28/10/2010	C	988,13
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244X5	BBK.EMPTOS/PAG 20101110	10/11/2010	C	987,31
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134244Z0	BBK.EMPTOS/PAG 20100910	10/09/2010	C	991,25
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134245A0	BBK.EMPTOS/PAG 20100615	15/06/2010	C	995,01
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134245B8	BBK.EMPTOS/PAG 20100618	18/06/2010	C	994,75
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134245C6	BBK.EMPTOS/PAG 20101220	20/12/2010	C	987,59
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687CH5	BBVAF/PAG 20100111	11/01/2010	C	999,39
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687CI3	BBVAF/PAG 20100112	12/01/2010	C	999,73
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687CN3	BBVAF/PAG 20100126	26/01/2010	C	998,94

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

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148435I4	CAIXAGALICIA/PAG 20101117	17/11/2010	C	987,10
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148435J2	CAIXAGALICIA/PAG 20100526	26/05/2010	C	995,04
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148435K0	CAIXAGALICIA/PAG 20100721	21/07/2010	C	992,30
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148435L8	CAIXAGALICIA/PAG 20100616	16/06/2010	C	994,34
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148435M6	CAIXAGALICIA/PAG 20101201	01/12/2010	C	987,57
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148453H9	CAI/PAG 20100108	08/01/2010	C	99.806,98
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148454A2	CAI/PAG 20100510	10/05/2010	C	99.509,50
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155303Q7	CA.RIOJA/PAG 20100614	14/06/2010	C	99.477,10
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155303V7	CA.RIOJA/PAG 20100222	22/02/2010	C	99.830,22
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155304C5	CA.RIOJA/PAG 20100419	19/04/2010	C	99.483,15
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155304E1	CA.RIOJA/PAG 20100527	27/05/2010	C	99.497,31
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155304F8	CA.RIOJA/PAG 20101215	15/12/2010	C	98.619,70
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155304G6	CA.RIOJA/PAG 20101214	14/12/2010	C	98.791,61
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155304H4	CA.RIOJA/PAG 20100318	18/03/2010	C	99.811,34
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146005S6	CA.MURCIA/PAG 20100624	24/06/2010	C	993,83
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146005T4	CA.MURCIA/PAG 20101126	26/11/2010	C	987,45
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146005U2	CA.MURCIA/PAG 20100604	04/06/2010	C	995,06
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854E37	CAJADUERO/PAG 20100205	05/02/2010	C	999,10
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854F02	CAJADUERO/PAG 20100401	01/04/2010	C	994,51
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854F36	CAJADUERO/PAG 20100507	07/05/2010	C	993,72
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854F77	CAJADUERO/PAG 20100701	01/07/2010	C	993,82
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854F93	CAJADUERO/PAG 20100113	13/01/2010	C	999,36
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854G92	CAJADUERO/PAG 20100415	15/04/2010	C	997,05
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854H00	CAJADUERO/PAG 20100326	26/03/2010	C	997,36
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854H59	CAJADUERO/PAG 20101110	10/11/2010	C	986,94
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854H67	CAJADUERO/PAG 20101118	18/11/2010	C	987,08
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149756M4	CA.CANTABRIA/PAG 20100219	19/02/2010	C	9.986,22
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149756S1	CA.CANTABRIA/PAG 20100609	09/06/2010	C	9.952,01
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149756Z6	CA.CANTABRIA/PAG 20100315	15/03/2010	C	9.983,74
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149757B5	CA.CANTABRIA/PAG 20100419	19/04/2010	C	9.945,76
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149757C3	CA.CANTABRIA/PAG 20100531	31/05/2010	C	9.952,00
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES05149771A3	BANCAJA/PAG 20100125	25/01/2010	C	997,42
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0514977J00	BANCAJA/PAG 20100216	16/02/2010	C	997,64
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0514977L06	BANCAJA/PAG 20101210	10/12/2010	C	987,76
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153082L0	CA.VITAL/PAG 20100429	29/04/2010	C	49.736,41
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153082N6	CA.VITAL/PAG 20100506	06/05/2010	C	49.745,04
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153082W7	CA.VITAL/PAG 20100903	03/09/2010	C	49.617,00
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153082Y3	CA.VITAL/PAG 20101001	01/10/2010	C	49.358,62
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153082Z0	CA.VITAL/PAG 20100401	01/04/2010	C	49.728,25
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153083A1	CA.VITAL/PAG 20101007	07/10/2010	C	49.373,38
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153083H6	CA.VITAL/PAG 20100630	30/06/2010	C	49.711,15
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153083K0	CA.VITAL/PAG 20100503	03/05/2010	C	49.734,98
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153083M6	CA.VITAL/PAG 20101116	16/11/2010	C	49.376,38
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153083N4	CA.VITAL/PAG 20101118	18/11/2010	C	49.363,70
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153083O2	CA.VITAL/PAG 20100729	29/07/2010	C	49.613,98
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153083P9	CA.VITAL/PAG 20100603	03/06/2010	C	49.734,23
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153083R5	CA.VITAL/PAG 20101214	14/12/2010	C	49.386,12
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA- ARABA ETA GASTEIZKI	ES05153083S3	CA.VITAL/PAG 20100318	18/03/2010	C	49.914,15
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144009R2	CAM/PAG 20100325	25/03/2010	C	997,99
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149615F6	CA.BURGOS/PAG 20100415	15/04/2010	C	9.942,36
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149616A5	CA.BURGOS/PAG 20101001	01/10/2010	C	9.871,50
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149616B3	CA.BURGOS/PAG 20100201	01/02/2010	C	9.976,78
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES05149100A0	CA.AVILA/PAG 20100217	17/02/2010	C	99.746,53
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES05149100E2	CA.AVILA/PAG 20101130	30/11/2010	C	98.716,68
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES05149100F9	CA.AVILA/PAG 20101202	02/12/2010	C	98.667,98
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES05149100H5	CA.AVILA/PAG 20101214	14/12/2010	C	98.693,78
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES05149107Z0	CA.AVILA/PAG 20100224	24/02/2010	C	99.878,81
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES05149108A5	CA.AVILA/PAG 20100428	28/04/2010	C	99.420,10
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES05149108B0	CA.AVILA/PAG 20100108	08/01/2010	C	99.772,82
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES05149109B5	CA.AVILA/PAG 20100201	01/02/2010	C	99.747,77
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES05149870R2	CA.EXTREM/PAG 20100331	31/03/2010	C	24.872,56
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES05149871R0	CA.EXTREM/PAG 20100315	15/03/2010	C	24.889,73
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES05149871S8	CA.EXTREM/PAG 20101112	12/11/2010	C	24.681,36
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES05149871U4	CA.EXTREM/PAG 20101214	14/12/2010	C	24.697,90
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA Y SAN SI	ES0515309567	KUTXA/PAG 20100930	30/09/2010	C	98.704,03
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA Y SAN SI	ES0515309575	KUTXA/PAG 20100401	01/04/2010	C	99.455,98
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA Y SAN SI	ES0515309583	KUTXA/PAG 20101013	13/10/2010	C	98.706,92
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA Y SAN SI	ES0515309609	KUTXA/PAG 20100224	24/02/2010	C	99.696,76
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA Y SAN SI	ES0515309617	KUTXA/PAG 20100422	22/04/2010	C	99.459,43
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE GIPUZKOA Y SAN SI	ES0515309658	KUTXA/PAG 20100426	26/04/2010	C	99.476,69
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES05149263B4	SA.NOSTRA/PAG 20100217	17/02/2010	C	9.974,12
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES05149264W8	SA.NOSTRA/PAG 20100201	01/02/2010	C	9.976,47
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES05149264Z1	SA.NOSTRA/PAG 20101116	16/11/2010	C	9.866,60
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES05149265B9	SA.NOSTRA/PAG 20100115	15/01/2010	C	9.992,75
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE LAS BALEARES	ES05149265D5	SA.NOSTRA/PAG 20101202	02/12/2010	C	9.866,80
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950AC1	CA.MADRID/PAG 20100118	18/01/2010	C	997,70
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950A8N	CA.MADRID/PAG 20100812	12/08/2010	C	991,64
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950BH8	CA.MADRID/PAG 20100119	19/01/2010	C	999,31
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950BJ4	CA.MADRID/PAG 20100421	21/04/2010	C	995,06
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950BO4	CA.MADRID/PAG 20101029	29/10/2010	C	987,52
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950BR7	CA.MADRID/PAG 20100210	10/02/2010	C	998,60
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950BX5	CA.MADRID/PAG 20100910	10/09/2010	C	991,36
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950CA1	CA.MADRID/PAG 20101217	17/12/2010	C	987,42
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950T41	CA.MADRID/PAG 20100111	11/01/2010	C	999,27
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950X60	CA.MADRID/PAG 20100507	07/05/2010	C	994,86

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950Z19	CA.MADRID/PAG 20100623	23/06/2010	C	994,79
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149659P3	CAN/PAG 20100105	05/01/2010	C	99.976,27
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149659S7	CAN/PAG 20100216	16/02/2010	C	99.898,44
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149659T5	CAN/PAG 20100323	23/03/2010	C	99.763,31
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149659Y5	CAN/PAG 20100511	11/05/2010	C	99.506,56
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0514965A86	CAN/PAG 20100126	26/01/2010	C	99.791,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0514965A94	CAN/PAG 20100907	07/09/2010	C	99.080,32
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0514965B36	CAN/PAG 20100223	23/02/2010	C	99.863,49
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0514965B44	CAN/PAG 20100928	28/09/2010	C	98.771,99
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0514965B69	CAN/PAG 20100427	27/04/2010	C	99.452,20
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0514965B85	CAN/PAG 20101012	12/10/2010	C	98.774,35
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0514965C19	CAN/PAG 20101123	23/11/2010	C	98.714,32
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0514965C27	CAN/PAG 20100824	24/08/2010	C	99.084,80
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0514965C50	CAN/PAG 20101214	14/12/2010	C	98.690,66
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0514959388	CA.SEGOVIA/PAG 20100115	15/01/2010	C	49.898,94
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0514959677	CA.SEGOVIA/PAG 20100315	15/03/2010	C	49.759,31
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0514959701	CA.SEGOVIA/PAG 20101116	16/11/2010	C	49.334,96
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0514959743	CA.SEGOVIA/PAG 20101214	14/12/2010	C	49.330,79
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149540Q3	IBERCAJA/PAG 20100218	18/02/2010	C	998,96
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149540U5	IBERCAJA/PAG 20100401	01/04/2010	C	994,91
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149541A5	IBERCAJA/PAG 20100506	06/05/2010	C	995,85
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149541V1	IBERCAJA/PAG 20100930	30/09/2010	C	987,63
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149541M0	IBERCAJA/PAG 20100325	25/03/2010	C	998,17
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149541P3	IBERCAJA/PAG 20101014	14/10/2010	C	987,65
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149541T5	IBERCAJA/PAG 20100204	04/02/2010	C	998,28
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149541U3	IBERCAJA/PAG 20101111	11/11/2010	C	987,21
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149541L2	IBERCAJA/PAG 20101118	18/11/2010	C	987,58
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149541W9	IBERCAJA/PAG 20100520	20/05/2010	C	995,16
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149541Y5	IBERCAJA/PAG 20100617	17/06/2010	C	994,76
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149542I6	IBERCAJA/PAG 20101209	09/12/2010	C	988,29
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGO	ES05149549Z6	IBERCAJA/PAG 20100121	21/01/2010	C	998,88
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO CATOLIC	ES05151340Y7	CAJACIRCULO/PAG 20100831	31/08/2010	C	99.250,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO CATOLIC	ES05151341A5	CAJACIRCULO/PAG 20100202	02/02/2010	C	99.768,21
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970FD6	LACAIXA/PAG 20100921	21/09/2010	C	988,13
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970HC4	LACAIXA/PAG 20100107	07/01/2010	C	999,12
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970HI1	LACAIXA/PAG 20100112	12/01/2010	C	999,24
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970HK7	LACAIXA/PAG 20100119	19/01/2010	C	998,61
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970HM3	LACAIXA/PAG 20100126	26/01/2010	C	998,67
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970IH1	LACAIXA/PAG 20100209	09/02/2010	C	997,68
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970IS8	LACAIXA/PAG 20100104	04/01/2010	C	999,21
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970IU4	LACAIXA/PAG 20100316	16/03/2010	C	996,46
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970J44	LACAIXA/PAG 20101214	14/12/2010	C	988,43
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970JQ0	LACAIXA/PAG 20100111	11/01/2010	C	998,36
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970JS6	LACAIXA/PAG 20100323	23/03/2010	C	995,55
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970KA2	LACAIXA/PAG 20100427	27/04/2010	C	995,06
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970LO1	LACAIXA/PAG 20100629	29/06/2010	C	992,37
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970LU8	LACAIXA/PAG 20100907	07/09/2010	C	991,78
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970NV2	LACAIXA/PAG 20101110	10/11/2010	C	988,17
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES05150091J8	CAJACANARIAS/PAG 20100129	29/01/2010	C	998,02
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES05150091V3	CAJACANARIAS/PAG 20100326	26/03/2010	C	994,87
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES05150091Z4	CAJACANARIAS/PAG 20100226	26/02/2010	C	996,76
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES05150092B3	CAJACANARIAS/PAG 20100423	23/04/2010	C	994,55
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES05150092D9	CAJACANARIAS/PAG 20100409	09/04/2010	C	995,65
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES05150092H0	CAJACANARIAS/PAG 20100219	19/02/2010	C	998,16
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES05150092J6	CAJACANARIAS/PAG 20100115	15/01/2010	C	999,25
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES05150092L2	CAJACANARIAS/PAG 20100312	12/03/2010	C	998,07
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES05149839V9	LA.CAJA/PAG 20100423	23/04/2010	C	49.721,75
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0514983A27	LA.CAJA/PAG 20100507	07/05/2010	C	49.703,27
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0514983D57	LA.CAJA/PAG 20100201	01/02/2010	C	49.884,19
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0514983D99	LA.CAJA/PAG 20101103	03/11/2010	C	49.332,53
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0514983E56	LA.CAJA/PAG 20101130	30/11/2010	C	49.351,03
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306C48	CR.NAVARRA/PAG 20100217	17/02/2010	C	49.923,48
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306E53	CR.NAVARRA/PAG 20100324	24/03/2010	C	49.846,60
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306E79	CR.NAVARRA/PAG 20100106	06/01/2010	C	49.977,28
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306E95	CR.NAVARRA/PAG 20100203	03/02/2010	C	49.948,63
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306F11	CR.NAVARRA/PAG 20100317	17/03/2010	C	49.850,86
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306F29	CR.NAVARRA/PAG 20100428	28/04/2010	C	49.752,19
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306F45	CR.NAVARRA/PAG 20100414	14/04/2010	C	49.829,71
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306F60	CR.NAVARRA/PAG 20100421	21/04/2010	C	49.842,02
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306F78	CR.NAVARRA/PAG 20100104	04/01/2010	C	49.986,41
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306F86	CR.NAVARRA/PAG 20101215	15/12/2010	C	49.389,25
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306F94	CR.NAVARRA/PAG 20101208	08/12/2010	C	49.405,81
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309912F3	ELE.CAP/PAG 20100113	13/01/2010	C	49.916,58
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309912I7	ELE.CAP/PAG 20100120	20/01/2010	C	49.915,21
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309912L1	ELE.CAP/PAG 20100203	03/02/2010	C	49.913,10
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309912N7	ELE.CAP/PAG 20100210	10/02/2010	C	49.912,94
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309912V0	ELE.CAP/PAG 20100107	07/01/2010	C	49.909,23
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309912Z1	ELE.CAP/PAG 20100127	27/01/2010	C	49.956,90
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913B0	ELE.CAP/PAG 20100512	12/05/2010	C	49.759,59
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913C8	ELE.CAP/PAG 20100519	19/05/2010	C	49.758,04
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913D6	ELE.CAP/PAG 20100526	26/05/2010	C	49.758,23
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913E4	ELE.CAP/PAG 20100602	02/06/2010	C	49.750,69
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913J5	ELE.CAP/PAG 20100714	14/07/2010	C	49.673,80
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913J3	ELE.CAP/PAG 20100721	21/07/2010	C	49.623,75
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913K1	ELE.CAP/PAG 20100901	01/09/2010	C	49.482,74

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913L9	ELE.CAP/PAG 20100303	03/03/2010	C	49.895,94
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913N5	ELE.CAP/PAG 20100317	17/03/2010	C	49.900,09
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913O3	ELE.CAP/PAG 20100324	24/03/2010	C	49.902,96
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913P0	ELE.CAP/PAG 20100331	31/03/2010	C	49.747,74
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913Q8	ELE.CAP/PAG 20100414	14/04/2010	C	49.751,00
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913R6	ELE.CAP/PAG 20100421	21/04/2010	C	49.750,42
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913S4	ELE.CAP/PAG 20100428	28/04/2010	C	49.752,49
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913T2	ELE.CAP/PAG 20100505	05/05/2010	C	49.754,50
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913U0	ELE.CAP/PAG 20100217	17/02/2010	C	49.913,81
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913V8	ELE.CAP/PAG 20100224	24/02/2010	C	49.911,65
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913W6	ELE.CAP/PAG 20100616	16/06/2010	C	49.753,25
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309913X4	ELE.CAP/PAG 20100623	23/06/2010	C	49.752,87
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870039	GAS/PAG 20100505	05/05/2010	C	995,11
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870088	GAS/PAG 20100215	15/02/2010	C	998,17
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870112	GAS/PAG 20100816	16/08/2010	C	991,78
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870161	GAS/PAG 20100125	25/01/2010	C	999,41
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870179	GAS/PAG 20100225	25/02/2010	C	998,18
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870195	GAS/PAG 20101105	05/11/2010	C	987,07
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870203	GAS/PAG 20101025	25/10/2010	C	987,77
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870211	GAS/PAG 20100517	17/05/2010	C	994,97
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870229	GAS/PAG 20101115	15/11/2010	C	987,10
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870237	GAS/PAG 20100525	25/05/2010	C	995,06
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870252	GAS/PAG 20100615	15/06/2010	C	994,71
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870260	GAS/PAG 20100115	15/01/2010	C	999,55
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870278	GAS/PAG 20100315	15/03/2010	C	998,15
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870286	GAS/PAG 20101203	03/12/2010	C	988,19
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870294	GAS/PAG 20100625	25/06/2010	C	993,91
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0516870302	GAS/PAG 20100325	25/03/2010	C	998,18
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0581380I07	UNF/PAG 20100115	15/01/2010	C	997,56
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0581380JA4	UNF/PAG 20100625	25/06/2010	C	992,79
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060252T4	HIDROCANTABRICO/PAG 20100114	14/01/2010	C	998,12
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060252Y4	HIDROCANTABRICO/PAG 20100215	15/02/2010	C	998,17
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253A2	HIDROCANTABRICO/PAG 20100226	26/02/2010	C	998,23
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253I5	HIDROCANTABRICO/PAG 20100129	29/01/2010	C	998,24
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253J3	HIDROCANTABRICO/PAG 20100430	30/04/2010	C	995,04
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253K1	HIDROCANTABRICO/PAG 20100730	30/07/2010	C	991,40
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253N5	HIDROCANTABRICO/PAG 20100531	31/05/2010	C	995,04
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253Q8	HIDROCANTABRICO/PAG 20100315	15/03/2010	C	998,20
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253R6	HIDROCANTABRICO/PAG 20100330	30/03/2010	C	995,07
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253S4	HIDROCANTABRICO/PAG 20101014	14/10/2010	C	987,59
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253T2	HIDROCANTABRICO/PAG 20100415	15/04/2010	C	994,80
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253U0	HIDROCANTABRICO/PAG 20101025	25/10/2010	C	987,09
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253V8	HIDROCANTABRICO/PAG 20101029	29/10/2010	C	987,70
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253W6	HIDROCANTABRICO/PAG 20100604	04/06/2010	C	994,98
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060253X4	HIDROCANTABRICO/PAG 20100615	15/06/2010	C	994,95
IBERDROLA, S.A.	ES0544580EL3	IBE/PAG 20100107	07/01/2010	C	999,66
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FK2	IBE/PAG 20100114	14/01/2010	C	997,97
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FL0	IBE/PAG 20100121	21/01/2010	C	998,55
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FM8	IBE/PAG 20100204	04/02/2010	C	999,06
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FR7	IBE/PAG 20100422	22/04/2010	C	995,03
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FS5	IBE/PAG 20100429	29/04/2010	C	995,23
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FT3	IBE/PAG 20100520	20/05/2010	C	995,36
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FU1	IBE/PAG 20100617	17/06/2010	C	992,90
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FW7	IBE/PAG 20100729	29/07/2010	C	991,89
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FY3	IBE/PAG 20100513	13/05/2010	C	995,66
IBERDROLA, S.A.	ES0544580GA1	IBE/PAG 20100826	26/08/2010	C	991,45
IBERDROLA, S.A.	ES0544580GE3	IBE/PAG 20101021	21/10/2010	C	988,33
IBERDROLA, S.A.	ES0544580GG8	IBE/PAG 20100527	27/05/2010	C	995,48
IBERDROLA, S.A.	ES0544580GH6	IBE/PAG 20100902	02/09/2010	C	991,78
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE CREDIT	ES05176175O9	LICO.LEASING/PAG 20101008	08/10/2010	C	98.613,49
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE CREDIT	ES05176175Q4	LICO.LEASING/PAG 20100218	18/02/2010	C	99.769,17
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANDO DE HU	ES05581971D3	CAJASOL/PAG 20100408	08/04/2010	C	994,82
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648723Y5	UNICAJA/PAG 20100120	20/01/2010	C	49.944,24
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648723Z2	UNICAJA/PAG 20100205	05/02/2010	C	49.886,95
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724A3	UNICAJA/PAG 20100219	19/02/2010	C	49.862,68
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724C9	UNICAJA/PAG 20100322	22/03/2010	C	49.859,86
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724D7	UNICAJA/PAG 20100420	20/04/2010	C	49.744,30
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724E5	UNICAJA/PAG 20100505	05/05/2010	C	49.768,83
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724J4	UNICAJA/PAG 20100621	21/06/2010	C	49.705,17
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724L0	UNICAJA/PAG 20100105	05/01/2010	C	49.959,39
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724P1	UNICAJA/PAG 20100906	06/09/2010	C	49.559,75
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724Q9	UNICAJA/PAG 20100920	20/09/2010	C	49.403,57
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724S5	UNICAJA/PAG 20101005	05/10/2010	C	49.392,63
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724V9	UNICAJA/PAG 20101119	19/11/2010	C	49.387,95
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724W7	UNICAJA/PAG 20101203	03/12/2010	C	49.439,28
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648724X5	UNICAJA/PAG 20101220	20/12/2010	C	49.381,21
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0573093N66	REE/PAG 20100301	01/03/2010	C	998,36
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0573093N90	REE/PAG 20100315	15/03/2010	C	998,38
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0573093O24	REE/PAG 20100430	30/04/2010	C	996,80
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0573093O73	REE/PAG 20100201	01/02/2010	C	998,35
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0573093O81	REE/PAG 20100215	15/02/2010	C	998,36
REPSOL YPF, S.A.	ES0573516665	REP/PAG 20100118	18/01/2010	C	999,58
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AH7	SAN.CONS.FIN/PAG 20100129	29/01/2010	C	998,23
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AI5	SAN.CONS.FIN/PAG 20100205	05/02/2010	C	997,50
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AJ3	SAN.CONS.FIN/PAG 20100219	19/02/2010	C	998,18

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AO3	SAN.CONS.FIN/PAG 20100326	26/03/2010	C	997,52
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AR6	SAN.CONS.FIN/PAG 20100430	30/04/2010	C	994,80
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AU0	SAN.CONS.FIN/PAG 20100507	07/05/2010	C	994,74
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BC6	SAN.CONS.FIN/PAG 20100618	18/06/2010	C	993,05
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BI3	SAN.CONS.FIN/PAG 20100716	16/07/2010	C	993,31
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BK9	SAN.CONS.FIN/PAG 20100108	08/01/2010	C	998,89
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BL7	SAN.CONS.FIN/PAG 20100806	06/08/2010	C	992,36
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BM5	SAN.CONS.FIN/PAG 20100115	15/01/2010	C	998,43
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BN3	SAN.CONS.FIN/PAG 20100813	13/08/2010	C	991,76
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BO1	SAN.CONS.FIN/PAG 20100820	20/08/2010	C	990,43
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BP8	SAN.CONS.FIN/PAG 20100122	22/01/2010	C	999,21
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BT0	SAN.CONS.FIN/PAG 20100917	17/09/2010	C	986,80
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BU8	SAN.CONS.FIN/PAG 20100226	26/02/2010	C	996,94
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BX2	SAN.CONS.FIN/PAG 20100312	12/03/2010	C	998,40
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BZ7	SAN.CONS.FIN/PAG 20101022	22/10/2010	C	987,43
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CD2	SAN.CONS.FIN/PAG 20101217	17/12/2010	C	987,48
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CG5	SAN.CONS.FIN/PAG 20100709	09/07/2010	C	993,08
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CP6	SAN.CONS.FIN/PAG 20100212	12/02/2010	C	998,34
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CS0	SAN.CONS.FIN/PAG 20100924	24/09/2010	C	988,22
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CU6	SAN.CONS.FIN/PAG 20100416	16/04/2010	C	995,77
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CV4	SAN.CONS.FIN/PAG 20101015	15/10/2010	C	987,74
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CW2	SAN.CONS.FIN/PAG 20100423	23/04/2010	C	994,77
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CZ5	SAN.CONS.FIN/PAG 20100514	14/05/2010	C	994,86
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495DA6	SAN.CONS.FIN/PAG 20101119	19/11/2010	C	988,24
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495DC2	SAN.CONS.FIN/PAG 20101126	26/11/2010	C	988,77
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495DD0	SAN.CONS.FIN/PAG 20100611	11/06/2010	C	995,48
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495DQ2	SAN.CONS.FIN/PAG 20100929	29/09/2010	C	987,20
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495DR0	SAN.CONS.FIN/PAG 20100409	09/04/2010	C	995,19
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495DS8	SAN.CONS.FIN/PAG 20101008	08/10/2010	C	989,37
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495DZ3	SAN.CONS.FIN/PAG 20101203	03/12/2010	C	986,94
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495ED8	SAN.CONS.FIN/PAG 20101210	10/12/2010	C	989,20
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495EE6	SAN.CONS.FIN/PAG 20100318	18/03/2010	C	998,19
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495EF3	SAN.CONS.FIN/PAG 20101223	23/12/2010	C	988,21
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495EH9	SAN.CONS.FIN/PAG 20100331	31/03/2010	C	998,17
TELEFONICA, S.A.	ES0578430HH1	TEF/PAG 20100115	15/01/2010	C	998,28
TELEFONICA, S.A.	ES0578430HI9	TEF/PAG 20100215	15/02/2010	C	998,28
TELEFONICA, S.A.	ES0578430HJ7	TEF/PAG 20100226	26/02/2010	C	998,32
TELEFONICA, S.A.	ES0578430HK5	TEF/PAG 20100315	15/03/2010	C	998,27
TELEFONICA, S.A.	ES0578430HM1	TEF/PAG 20100330	30/03/2010	C	998,31

PARTICIPACIONES PREFERENTES

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

RENTA VARIABLE

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
ABENGOA, S.A.	ES0105200416	ABG/AC 0,25			20,09
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0111845014	ABE/AC 3,00			15,38
ACCIONA, S.A.	ES0125220311	ANA/AC 1,00			88,97
ACERINOX, S.A.	ES0132105018	ACX/AC 0,25			14,11
ACS, ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS, S.A.	ES0167050915	ACS/AC 0,50			34,02
ADOLFO DOMINGUEZ, S.A.	ES0106000013	ADZ/AC 0,60			11,63
AFIRMA GRUPO INMOBILIARIO, S.A.	ES0110944016	AFR/AC 0,20			0,34
AGRICOLA DE FRUTOS SECOS, S.A.	ES0106325014	AGROFRUSE/AC 3,01			11,01
AHORRO FAMILIAR, S.A.	ES0107511018	AH.FAMILIAR/AC 6,00			25,93
ALFA S.A. DE C.V.	MXP000511016	AC. ALFA S/A			40,54
ALMIRALL, S.A.	ES0157097017	ALM/AC 0,12			9,08
AMCI HABITAT, S.A.	ES0109196313	AMCI/AC 3,00			5,20
AMERICA MOVIL, S.A. DE C.V.	MXP001691213	AC. AMERICA MOVIL. S/L			31,76
AMPER, S.A.	ES0109260531	AMP/AC 1,00			6,50
ANTENA 3 DE TELEVISION, S.A.	ES0109427734	A3TV/AC 0,75			6,51
ARCELOR MITTAL, S.A.	LU0323134006	ARCELORMITTAL/AC SVN			26,42
AVANZIT, S.A.	ES0172708317	AVZ/AC 0,50			0,78
AZKOYEN, S.A.	ES0112458312	AZK/AC 0,60			3,12
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0113211835	BBVA/AC 0,49			12,50
BANCO BRADESCO, S.A.	BRBBDACACNPR8	AC. BANCO BRADESCO -PREF.-			14,19
BANCO DE CHILE, S.A.	CLP0939W1081	AC. BANCO DE CHILE			33,43
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0113860A34	SAB/AC 0,125			4,47
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0113980F34	BVA/AC 0,25			5,74
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0113440038	BTO/AC 0,79			8,78
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0113580C31	GUI/AC 0,25			5,42
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0113580D30	GUI/ACPREF A 0,25			7,66
BANCO PASTOR, S.A.	ES0113770A34	PAS/AC 0,33			5,10
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0113790531	POP/AC 0,10			5,96
BANCO RIO DE LA PLATA, S.A.	ARBRI0010194	AC. BCO SANTANDER RIO. S/B			1,38
BANCO SANTANDER PUERTO RICO	PR8028091034	AC. SANTANDER BANCORP			7,67
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0113900J37	SAN/AC 0,50			11,38
BANKINTER, S.A.	ES0113679I37	BKT/AC 0,30			7,51
BARON DE LEY, S.A.	ES0114297015	BDL/AC 0,60			34,60
BAYER AKTIENGESELLSCHAFT	DE000BAY0017	AC. BAYER			50,55
BBVA BANCO FRANCES, S.A.	ARP125991090	AC. BBVA BCO. FRANCES			1,35
BEFESA MEDIO AMBIENTE, S.A.	ES0114491014	BMA/AC 3,01			15,21
BODEGAS BILBAINAS, S.A.	ES0114930011	BODEGAS.BILB/AC 6,01			9,00
BODEGAS RIOJANAS, S.A.	ES0115002018	RIO/AC 0,75			7,38
BOLSAS Y MERCADOS ESPAÑOLES, SDAD HOLDING DE MDOS Y	ES0115056139	BME/AC 3,23			23,35
BRADESPAR	BRBRAPACNOR5	AC. BRADESPAR			13,91
BRADESPAR	BRBRAPACNPR2	AC. BRADESPAR -PREF.-			14,57
BRASKEM, S.A.	BRBRKMACNPA4	AC. BRASKEM -PREF.-			4,83
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0114400007	CAM/CUPARTVA 2,00			5,77
CAMPOFRIO FOOD GROUP, S.A.	ES0121501318	CFG/AC 1,00			6,96
CARTERA INDUSTRIAL REA, S.A.	ES0162292017	CART.IND.REA/AC 2,30			3,02
CEMENTOS MOLINS, S.A.	ES0117360117	CEMENTOS.MOLINS/AC 0,30			8,36
CEMENTOS PORTLAND VALDERRIVAS, S.A.	ES0117390A11	CPL/AC 1,50			29,17
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNOR6	AC. ELETROBRAS			11,73
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNPB7	AC. ELETROBRAS. PREF. S/B			10,32
CIE AUTOMOTIVE, S.A.	ES0105630315	CIE/AC 0,25			3,78
CLINICA BAVIERA, S.A.	ES0119037010	CBVA/AC 0,10			8,22
CODERE, S.A.	ES0119256115	CDR/AC 0,20			5,98
COMPANHIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	BRCMIGACNPR3	AC. CEMIG -PREF.-			11,56
COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	BRCPLEACNPB9	AC. COPEL -PREF.-			13,29
COMPANYIA D'AIGÜES DE SABADELL, S.A.	ES0107350011	AGUAS.SAB/AC B 12,02			59,73
COMPañIA DE INVERSIONES MOBILIARIAS BARCINO, S.A.	ES0155972237	INV.MOB.BARCINO/AC 1,00			1,47
COMPañIA ESPAÑOLA DE PETROLEOS, S.A.	ES0132580319	CEP/AC 1,00			23,50
COMPañIA ESPAÑOLA DE VIVIENDAS EN ALQUILER, S.A.	ES0132955016	CEVASA/AC 6,00			156,90
COMPañIA LEVANTINA DE EDIFICACION Y OBRAS PUBLICAS, S.A.	ES0158300410	CLEO/AC 1,00			8,93
COMPañIA LOGISTICA DE HIDROCARBUROS CLH, S.A.	ES0110480219	CLH/AC D 1,20			40,22
COMPañIA VINICOLA DEL NORTE DE ESPAÑA, S.A.	ES0184140210	CUN/AC 0,24			14,48
CONSTRUCCIONES Y AUXILIAR DE FERROCARRILES, S.A.	ES0121975017	CAF/AC 3,01			348,41
CORPORACION DERMOESTETICA, S.A.	ES0124204019	DERM/AC 0,10			3,29
CORPORACION FINANCIERA ALBA, S.A.	ES0117160111	ALB/AC 1,00			36,83
CORPORACION GEO, S.A. DE C.V.	MXP3142C1177	AC. GEO. S/B			1,88
CRITERIA CAIXACORP, S.A.	ES0140609019	CRI/AC 1,00			3,38
DINAMIA CAPITAL PRIVADO, S.A., SCR	ES0126501131	DIN/AC 3,00			10,69
DURO FELGUERA, S.A.	ES0162600417	MDF/AC 0,50			7,05
EBRO PULEVA, S.A.	ES0112501012	EVA/AC 0,60			13,39
ECCOWOOD INVEST, S.A.	ES0127232017	ECCOWOOD/AC 1,00			1,32
ELECNR, S.A.	ES0129743318	ENO/AC 0,10			12,02
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD, S.A.	CLP3710M1090	AC. ENDESA CHILE			32,25
ENAGAS, S.A.	ES0130960018	ENG/AC 1,50			14,38
ENDESA, S.A.	ES0130670112	ELE/AC 1,20			22,43
ENERSIS, S.A.	CLP371861061	AC. ENERSIS			12,91
ERCROS, S.A.	ES0125140A14	ECR/AC 1,60			1,46
ESPAÑOLA DEL ZINC, S.A.	ES0132970213	ZNC/AC 1,00			1,32
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE AND SPACE COMPANY EADS	NL0000235190	AC. EADS			13,32
EXIDE TECHNOLOGIES, S.A.	ES0131600019	TUD/AC 3,01			7,47
FAES FARMA, S.A.	ES0134950F36	FAE/AC 0,10			3,89
FEDERICO PATERNINA, S.A.	ES0114989017	PAT/AC 6,01			7,35
FERGO AISA, S.A.	ES0106585013	AISA/AC 1,00			1,84
FERROVIAL, S.A.	ES0118900010	FER/AC 0,20			7,84
FERSA ENERGIAS RENOVABLES, S.A.	ES0136463017	FRS/AC 1,00			2,10
FINANZAS E INVERSIONES VALENCIANAS, S.A.	ES0138152113	F&I.VALENCIANAS/AC 1,00			96,30

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

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