

III. OTRAS DISPOSICIONES

MINISTERIO DE ECONOMÍA Y HACIENDA

3467 Orden EHA/455/2009, de 26 de febrero, por la que se aprueba la relación de valores negociados en mercados organizados, con su valor de negociación medio correspondiente al cuarto trimestre de 2008, a efectos de la declaración informativa anual acerca de valores, seguros y rentas.

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

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

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

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

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

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

En su virtud, dispongo:

Artículo único. Aprobación de las relaciones de valores negociados.

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

Disposición final. *Entrada en vigor.*

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

Madrid, 26 de febrero de 2009.–El Vicepresidente Segundo del Gobierno y Ministro de Economía y Hacienda, Pedro Solbes Mira.

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 2008, a los 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 la actuación y los procedimientos de gestión e inspección tributaria y de desarrollo de las normas comunes de los procedimientos de aplicación de los tributos.

Criterio de ordenación:

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

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

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
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	101,877
ESTADO	ES0000011470	ESTADO/8,20 OBE 20090228	28/02/2009	8,200	101,508
ESTADO	ES0000011595	ESTADO/8,70 OBE 20120228	28/02/2012	8,700	116,144
ESTADO	ES0000011660	ESTADO/6,15 OBE SEGR 20130131	31/01/2013	6,150	109,648
ESTADO	ES0000011819	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20090131	31/01/2009	C	99,287
ESTADO	ES0000011827	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20100131	31/01/2010	C	96,892
ESTADO	ES0000011835	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20110131	31/01/2011	C	93,519
ESTADO	ES0000011843	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20120131	31/01/2012	C	90,018
ESTADO	ES0000011850	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20130131	31/01/2013	C	86,092
ESTADO	ES0000011868	ESTADO/6,00 OBE SEGR 20290131	31/01/2029	6,000	117,999
ESTADO	ES0000011884	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20140131	31/01/2014	C	82,603
ESTADO	ES0000011892	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20150131	31/01/2015	C	77,816
ESTADO	ES0000011918	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20170131	31/01/2017	C	72,441
ESTADO	ES0000011926	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20180131	31/01/2018	C	66,083
ESTADO	ES0000012007	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20260131	31/01/2026	C	48,039
ESTADO	ES0000012064	ESTADO/5,15 OBE SEGR 20090730	30/07/2009	5,150	101,604
ESTADO	ES0000012098	ESTADO/4,75 OBE SEGR 20140730	30/07/2014	4,750	105,224
ESTADO	ES00000120D1	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20370131	31/01/2037	C	25,551
ESTADO	ES00000120E9	ESTADO/3,25 BOEST SEGR 20100730	30/07/2010	3,250	100,527
ESTADO	ES00000120F6	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20100730	30/07/2010	C	94,909
ESTADO	ES00000120G4	ESTADO/3,15 OBE SEGR 20160131	31/01/2016	3,150	95,246
ESTADO	ES00000120J8	ESTADO/3,80 OBE SEGR 20170131	31/01/2017	3,800	98,575
ESTADO	ES00000120L4	ESTADO/3,90 BOEST SEGR 20121031	31/10/2012	3,900	101,338
ESTADO	ES00000120N0	ESTADO/4,90 OBE SEGR 20400730	30/07/2040	4,900	104,945
ESTADO	ES00000120O8	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20400730	30/07/2040	C	24,032
ESTADO	ES00000120X9	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20121031	31/10/2012	C	87,691
ESTADO	ES00000120Z4	ESTADO/4,10 BOEST SEGR 20110430	30/04/2011	4,100	101,869
ESTADO	ES0000012122	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20090730	30/07/2009	C	98,040
ESTADO	ES00000121A5	ESTADO/4,10 OBE SEGR 20180730	30/07/2018	4,100	99,321
ESTADO	ES00000121G2	ESTADO/4,80 OBESEGR 20240131	31/01/2024	4,800	103,653
ESTADO	ES00000121H0	ESTADO/4,25 BOEST SEGR 20140131	31/01/2014	4,250	102,209
ESTADO	ES0000012221	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20090730	30/07/2009	C	98,700
ESTADO	ES0000012239	ESTADO/4,00 OBE SEGR 20100131	31/01/2010	4,000	101,391
ESTADO	ES0000012296	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20100131	31/01/2010	C	96,701
ESTADO	ES0000012304	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20140730	30/07/2014	C	80,304
ESTADO	ES0000012312	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20100730	30/07/2010	C	95,509
ESTADO	ES0000012353	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20140730	30/07/2014	C	80,503
ESTADO	ES0000012387	ESTADO/5,40 OBE SEGR 20110730	30/07/2011	5,400	105,346
ESTADO	ES0000012411	ESTADO/5,75 OBE 20320730	30/07/2032	5,750	116,238
ESTADO	ES0000012429	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20110730	30/07/2011	C	92,009
ESTADO	ES0000012452	ESTADO/5,35 OBE SEGR 20111031	31/10/2011	5,350	105,462
ESTADO	ES0000012510	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20111031	31/10/2011	C	90,620
ESTADO	ES0000012619	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20160730	30/07/2016	C	75,425
ESTADO	ES0000012775	ESTADO/CUPCER CUPSEGR 20320730	30/07/2032	C	36,192
ESTADO	ES0000012783	ESTADO/5,50 OBE SEGR 20170730	30/07/2017	5,500	110,301
ESTADO	ES0000012791	ESTADO/5,00 OBE SEGR 20120730	30/07/2012	5,000	104,916
ESTADO	ES0000012817	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20170730	30/07/2017	C	69,441
ESTADO	ES0000012866	ESTADO/4,20 OBE SEGR 20130730	30/07/2013	4,200	102,241
ESTADO	ES0000012874	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20130730	30/07/2013	C	85,345
ESTADO	ES0000012882	ESTADO/3,60 BOEST SEGR 20090131	31/01/2009	3,600	100,123
ESTADO	ES0000012890	ESTADO/CUPCER PPALSEGR 20090131	31/01/2009	C	99,140
ESTADO	ES0000012916	ESTADO/4,40 OBE SEGR 20150131	31/01/2015	4,400	102,681
ESTADO	ES0000012932	ESTADO/4,20 OBE SEGR 20370131	31/01/2037	4,200	93,793
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095598	GENCAT/5,00 OB 20090715	15/07/2009	5,000	100,715
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095697	GENCAT/VAR OB 20140704	04/07/2014	V	98,407
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095770	GENCAT/5,20 OB 20120930	30/09/2012	5,200	105,157
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095846	GENCAT/3,75 BO 20100215	15/02/2010	3,750	99,330
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095887	GENCAT/3,25 OB 20111130	30/11/2011	3,250	98,050
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095895	GENCAT/4,30 OB 20161115	15/11/2016	4,300	101,300
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0000095911	GENCAT/3,85 BO 20110930	30/09/2011	3,850	100,855
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959N0	GENCAT/PAG 20090224	24/02/2009		98,723
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959P5	GENCAT/PAG 20090113	13/01/2009		99,553
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959Q3	GENCAT/PAG 20090407	07/04/2009		97,377
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959R1	GENCAT/PAG 20090210	10/02/2009		99,006
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959T7	GENCAT/PAG 20090526	26/05/2009		98,674
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959V3	GENCAT/PAG 20090623	23/06/2009		96,697
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959W1	GENCAT/PAG 20090421	21/04/2009		97,811
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959Y7	GENCAT/PAG 20090908	08/09/2009		96,857
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES05000959Z4	GENCAT/PAG 20090922	22/09/2009		95,828
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095A05	GENCAT/PAG 20091020	20/10/2009		95,051
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095A13	GENCAT/PAG 20091110	10/11/2009		96,179
GENERALITAT DE CATALUNYA	ES0500095A39	GENCAT/PAG 20091209	09/12/2009		96,312
GOBIERNO VASCO	ES0000106429	GOB.VASCO/5,55 OB 20141126	26/11/2014	5,550	109,839

(*) ANCV: Agencia Nacional de Codificación de Valores

(**) V: Cupón Variable, C: Cupón Cero

**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.	ES0000230179	BCO.CTO.LOCAL/4,00 CEDHIP 20090331	31/03/2009	4,000	5,89
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0000230187	BCO.CTO.LOCAL/4,00 CEDHIP 20100630	30/06/2010	4,000	5,76
EMPRESTITO DEL MAZJEN	ES0002750000	EMPTO.MAJZEN/4,00 OB 20220701	01/07/2022	4,000	2,11
GENERALIDAD VALENCIANA	ES0500105DJ7	GENVAL/PAG 20090218	18/02/2009		984,94
GENERALIDAD VALENCIANA	ES0500105DM1	GENVAL/PAG 20090311	11/03/2009		984,14
GENERALIDAD VALENCIANA	ES0500105DN9	GENVAL/PAG 20090401	01/04/2009		990,49
GENERALIDAD VALENCIANA	ES0500105DP4	GENVAL/PAG 20090422	22/04/2009		976,79
GENERALIDAD VALENCIANA	ES0500105EK3	GENVAL/PAG 20091021	21/10/2009		953,90

LETRAS DEL TESORO

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Porcentaje
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00901238	ESTADO/LT 20090123	23/01/2009	C	99,478
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00902202	ESTADO/LT 20090220	20/02/2009	C	99,184
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00903200	ESTADO/LT 20090320	20/03/2009	C	99,023
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00904174	ESTADO/LT 20090417	17/04/2009	C	98,753
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00905221	ESTADO/LT 20090522	22/05/2009	C	98,530
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00906195	ESTADO/LT 20090619	19/06/2009	C	98,396
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00907177	ESTADO/LT 20090717	17/07/2009	C	98,099
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00908217	ESTADO/LT 20090821	21/08/2009	C	97,520
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00909181	ESTADO/LT 20090918	18/09/2009	C	97,430
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00910239	ESTADO/LT 20091023	23/10/2009	C	97,373
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00911203	ESTADO/LT 20091120	20/11/2009	C	97,873
DIRECCION GENERAL DEL TESORO Y POLITICA FINANCIERA	ES0L00912185	ESTADO/LT 20091218	18/12/2009	C	98,045

OBLIGACIONES

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211845211	ABE/5,125 OB 20170612	12/06/2017	5,125	44.442,19
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0211847076	AUMAR/3,53 OB 20090608	08/06/2009	3,530	981,95
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR-LEONESA, S.A.	ES0211843083	AUCALSA/4,00 OB 20140608	08/06/2014	4,000	437,54
AUTOPISTA CONCESIONARIA ASTUR-LEONESA, S.A.	ES0211843091	AUCALSA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3,700	427,88
AUTOPISTA VASCO-ARAGONESA, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211837077	AVASA/3,55 OB 20150615	15/06/2015	3,550	816,95
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839107	AUDASA/4,19 OB 20110531	31/05/2011	4,190	472,08
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839115	AUDASA/4,33 OB 20120516	16/05/2012	4,330	562,20
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839123	AUDASA/3,83 OB 20130626	26/06/2013	3,830	432,18
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839131	AUDASA/4,00 OB 20140608	08/06/2014	4,000	447,34
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839149	AUDASA/3,32 OB 20151212	12/12/2015	3,320	411,83
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839156	AUDASA/3,70 OB 20160517	17/05/2016	3,700	440,79
AUTOPISTAS DEL ATLANTICO, CONCESIONARIA ESPAÑOLA, S.A.	ES0211839164	AUDASA/4,85 OB 20180327 GTIA	27/03/2018	4,850	451,10
AUTOVIA DE LOS VIÑEDOS, S.A. CONCES. D LA JUNTA DE COMUN	ES0211966009	AUVISA/4,79 OB 20271215	15/12/2027	4,790	92.790,82
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211081	BBVA/VAR OB SUBD 20151112	12/11/2015	V	95.945,91
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0213211099	BBVA/VAR OB SUBD 20191020	20/10/2019	V	85.590,03
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213180013	ATL/VAR OB SUBD 20101001	01/10/2010	V	600,02
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213180021	ATL/VAR OB SUBD 20111001	01/10/2011	V	600,02
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860028	SAB/VAR OB SUBD 20140218	18/02/2014	V	97.866,50
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0213860036	SAB/VAR OB SUBD 20160525	25/05/2016	V	87.140,00
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980016	BVA/VAR OB SUBD 20110329	29/03/2011	V	6.031,38
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980024	BVA/VAR OB SUBD 20141215	15/12/2014	V	3.017,34
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0213980040	BVA/VAR OB SUBD 20170323	23/03/2017	V	39.121,02
BANCO EUROPEO DE INVERSIONES	ES0213469580	BEI/8,50 OB 20210617	17/06/2021	8,500	637,07
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051008	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20130630	30/06/2013	V	599,68
BANCO GALLEGO, S.A.	ES0213051016	BCO.GALLEGO/VAR OB SUBD 20131030	30/10/2013	V	599,62
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580006	GUI/4,75 OB SUBD 20110415	15/04/2011	4,750	485,55
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580014	GUI/4,50 OB SUBD 20121015	15/10/2012	4,500	495,67
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580022	GUI/4,20 OB SUBD 20141015	15/10/2014	4,200	459,04
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0213580030	GUI/VAR OB SUBD 20160321	21/03/2016	V	99.303,91
BANCO PASTOR, S.A.	ES0213770011	PAS/VAR OB SUBD PERP		V	60.000,00
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0213540018	BBE/VAR OB SUBD 20160323	23/03/2016	V	94.593,00
BANKINTER, S.A.	ES0213679121	BKT/VAR OB 20150316	16/03/2015	V	467,00
BANKINTER, S.A.	ES0213679170	BKT/VAR OB SUBD 20170316	16/03/2017	V	96.446,53
BANKINTER, S.A.	ES0213679188	BKT/VAR OBSUBD 20181010	10/10/2018	V	49.997,50
BARCLAYS BANK, S.A.	ES0214050033	ZRG/VAR OB SUBD 20090701	01/07/2009	V	600,01
BARCLAYS BANK, S.A.	ES0214050041	ZRG/VAR OB SUBD 20110101	01/01/2011	V	600,02
BILBAO BIZKAIA KUTXA, AURREZKI KUTXA ETA BAHITETXEA	ES0214100002	BBK/VAR OB SUBD 20150928	28/09/2015	V	97.752,50
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0214958011	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20180108	08/01/2018	V	30,00
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0214958029	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20180804	04/08/2018	V	600,06
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES0214958037	CAIXANOVA/VAR OB SUBD 20190126	26/01/2019	V	599,76
CAIXA D'ESTALVIS COMARCAL DE MANLLEU	ES0214841027	CA.MANLLEU/VAR OB SUBD 20130601	01/06/2013	V	499,86
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840201	CA.CATALUNYA/VAR OB SUBD 20150519	19/05/2015	V	1.500,01
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840235	CA.CATALUNYA/VAR OB SUBD 20200220	20/02/2020	V	1.499,99
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840342	CA.CATALUNYA/VAR OBSUBD 20181218	18/12/2018	V	500,01
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0214840367	CA.CATALUNYA/CUPCER OB 20380115	15/01/2038	C	50.000,00
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0213249008	CA.GIRONA/VAR OB SUBD 20160921	21/09/2016	V	97.058,95

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0214850051	CA.MANRESA/VAR OB SUBD 20160505	05/05/2016	V	97.121,20
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0314973027	CA.SABADELL/VAR OB SUBD PERP		V	598,73
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346000	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20150527	27/05/2015	V	600,60
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346018	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20151027	27/10/2015	V	602,41
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346026	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20160427	27/04/2016	V	601,80
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346034	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20161027	27/10/2016	V	602,34
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346042	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20170127	27/01/2017	V	502,52
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346059	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20171127	27/11/2017	V	497,54
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0215346067	CA.TARRAGONA/VAR OB SUBD 20180727	27/07/2018	V	496,34
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	999,58
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974042	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20190730	30/07/2019	V	999,63
CAIXA D'ESTALVIS DE TERRASSA	ES0214974067	CA.TERRASSA/VAR OB SUBD 20210809	09/08/2021	V	89.947,93
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966006	CA.PENEDES/VAR OB SUBD PERP		V	600,77
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966014	CA.PENEDES/VAR OB SUBD PERP		V	999,69
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0214966022	CA.PENEDES/VAR OB SUBD 20161222	22/12/2016	V	999,60
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0214846042	CA.LAIETANA/VAR OB SUBD 20211010	10/10/2021	V	999,76
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0214846059	CA.LAIETANA/VAR OB SUBD 20350315	15/03/2035	V	999,78
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979058	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20091215	15/12/2009	V	1.000,06
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979066	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20111106	06/11/2011	V	999,91
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979082	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20121001	01/10/2012	V	999,88
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979116	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20131001	01/10/2013	V	999,90
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979132	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20141025	25/10/2014	V	999,97
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979157	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20151128	28/11/2015	V	1.000,08
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA	ES0214979173	CA.GUADALAJ/VAR OB SUBD 20171227	27/12/2017	V	999,89
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0214826002	CAJASTUR/VAR OB SUBD 20121230	30/12/2012	V	99,99
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214825012	CA.ALBACETE/VAR OB SUBD PERP		V	613,02
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214825020	CA.ALBACETE/VAR OB SUBD PERP		V	610,40
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214842017	CA.CUENCA-C.R./VAR OB SUBD PERP		V	302,65
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0214842025	CA.CUENCA-C.R./VAR OB PREF PERP		V	304,93
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424075	CCM/VAR OB SUBD 20090515	15/05/2009	V	300,51
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424096	CCM/VAR OB SUBD 20110604	04/06/2011	V	600,01
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0215424120	CCM/VAR OB SUBD 20141220	20/12/2014	V	196.689,54
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843015	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD PERP		V	598,59
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843023	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD PERP		V	600,09
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843080	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20121001	01/10/2012	V	583,64
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843098	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20131103	03/11/2013	V	596,29
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843106	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20140401	01/04/2014	V	592,92
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843114	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20150104	04/01/2015	V	592,52
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0214843122	CAIXAGALICIA/VAR OB SUBD 20150704	04/07/2015	V	515,08
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	98.911,56
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845028	CAI/VAR OB SUBD 20160525	25/05/2016	V	46.997,50
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES0214845036	CAI/VAR OB SUBD 20190228	28/02/2019	V	999,80
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600035	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	304,16
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600043	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	306,74
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600050	CA.MURCIA/VAR OB SUBD PERP		V	300,47
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	300,50
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	501,43
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0214600217	CA.MURCIA/VAR OB SUBD 20140315	15/03/2014	V	99.700,36
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0214854020	CAJADUERO/VAR OB SUBD 20181219	19/12/2018	V	50.001,75
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0214975007	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20121010	10/10/2012	V	999,86
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0214975015	CA.CANTABRIA/VAR OB SUBD 20140330	30/03/2014	V	999,90
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977037	BANCAJAVAR OB SUBD PERP		V	601,05
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977052	BANCAJAVAR OB SUBD 20220704	04/07/2022	V	1.000,74
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977060	BANCAJAV/3,94 OB 20150918	18/09/2015	3,940	1.000,66
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977078	BANCAJAVAR OB SUBD 20181129	29/11/2018	V	79.259,68
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0214977102	BANCAJAVAR OB SUBD PERP		V	75.558,58
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0215307028	CA.SAGUNTO/VAR OB SUBD PERP		V	603,52
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0215307036	CA.SAGUNTO/VAR OB SUBD 20120630	30/06/2012	V	604,59
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0214957013	CA.VITAL/10,00 OB SUBD PERP		10,000	304,84
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0214400014	CAM/VAR OB SUBD PERP		V	605,21
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0214400048	CAM/VAR OB SUBD PERP		V	600,02
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0214400055	CAM/VAR OB 20150815	15/08/2015	V	1.000,06
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0215395015	CAM/VAR OB SUBD PERP		V	608,58
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0214910012	CA.AVILA/VAR OBSUBD 20181029	29/10/2018	V	50.005,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0214926018	SA.NOSTRA/VAR OB SUBD 20141230	30/12/2014	V	97.849,07
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0214926026	SA.NOSTRA/VAR OB SUBD 20150318	18/03/2015	V	1.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0264730039	CAJASUR/VAR OB SUBD 20131201	01/12/2013	V	500,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES0264730054	CAJASUR/VAR OB SUBD 20150311	11/03/2015	V	97.287,82
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES0214987028	CA.EXTREM/VAR OB SUBD 20171115	15/11/2017	V	500,01
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	8.478,56
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950034	CA.MADRID/VAR OB 20090409	09/04/2009	V	99,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950059	CA.MADRID/6,25 OB SUBD 20120410	10/04/2012	6,250	96.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950109	CA.MADRID/4,00 OB 20110302	02/03/2011	4,000	945,49
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950117	CA.MADRID/3,76 OB 20110331	31/03/2011	3,760	937,63
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950125	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20140715	15/07/2014	V	97.355,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950141	CA.MADRID/VAR OB SUBD 20180301	01/03/2018	V	83.823,31
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0214950174	CA.MADRID/VAR OB 20140626	26/06/2014	V	990,66
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES0214965008	CAN/VAR OB SUBD 20160616	16/06/2016	V	93.695,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT	ES0214955017	CA.ONTINYENT/VAR OB SUBD 20130528	28/05/2013	V	6.000,36
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ONTINYENT	ES0214955025	CA.ONTINYENT/VAR OB SUBD 20160428	28/04/2016	V	6.000,56
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0214954010	IBERCAJA/VAR OB PREF PERP		V	601,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0214954028	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP		V	601,01

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0214954036	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP		V	601,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0214954044	IBERCAJA/VAR OB SUBD PERP		V	601,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0214954069	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20140715	15/07/2014	V	469,78
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0214954150	IBERCAJA/VAR OB SUBD 20190425	25/04/2019	V	425,18
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0214970024	LACAIXA/VAR OB SUBD 20091004	04/10/2009	V	1.000,00
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 ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE	ES0215474026	CA.ESPAÑA/5,75 OB SUBD 20150627	27/06/2015	5,750	982,15
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE	ES0215474166	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20181229	29/12/2018	V	974,93
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE	ES0215474190	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20151207	07/12/2015	V	97.641,04
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE	ES0215474208	CA.ESPAÑA/VAR OB SUBD 20160131	31/01/2016	V	990,32
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE	ES0215474232	CA.ESPAÑA/7,50 OBSUBD 20180828	28/08/2018	7,500	995,32
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981013	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD PERP		V	603,48
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981039	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20321015	15/10/2032	V	299,48
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981054	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20200628	28/06/2020	V	299,51
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214981070	CAJACANARIAS/VAR OB SUBD 20151104	04/11/2015	V	96.669,08
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES0214982110	CA.GRANADA/VAR OB SUBD 20150630	30/06/2015	V	97.755,81
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983019	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP		V	302,80
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983035	LA.CAJA/VAR OB SUBD PERP		V	302,05
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983084	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20120801	01/08/2012	V	599,94
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983092	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20131101	01/11/2013	V	499,99
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0214983118	LA.CAJA/VAR OB SUBD 20150412	12/04/2015	V	98.411,00
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CF	ES0215316029	RURALCAJA/VAR OB SUBD 20151122	22/11/2015	V	95.310,00
CORPORACION DE RESERVAS ESTRATEGICA DE PRODUCTOS F	ES0224261018	CORES/4,50 OB 20180423	23/04/2018	4,500	96.917,81
DEUTSCHE BANK, A.G.	DE0003933693	OB. DEUTSCHE BANK	10/11/2014	4,155	883,63
DEUTSCHE BANK, SOCIEDAD ANONIMA ESPAÑOLA	ES0213320015	DT.BK.SAE/VAR OB SUBD 20131230	30/12/2013	V	84,68
DEUTSCHE BANK, SOCIEDAD ANONIMA ESPAÑOLA	ES0213320023	DT.BK.SAE/VAR OB SUBD 20140331	31/03/2014	V	81,96
DEUTSCHE BANK, SOCIEDAD ANONIMA ESPAÑOLA	ES0213320031	DT.BK.SAE/VAR OB 20150331	31/03/2015	V	87,68
ENDESA, S.A.	ES0230670210	ELE/4,20 OB 20090225	25/02/2009	4,200	99.785,85
EROSKI SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429004	EROSKI/VAR OB SUBD PERP		V	25,01
EROSKI SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0231429038	EROSKI/VAR OB SUBD PERP		V	25,01
FAGOR ELECTRODOMESTICOS, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0235972009	FAGOR/VAR OB SUBD 1º PERP		V	24,98
FAGOR ELECTRODOMESTICOS, SOCIEDAD COOPERATIVA	ES0235972017	FAGOR/VAR OB SUBD 2º PERP		V	25,00
IBERDROLA, S.A.	ES0244520138	HIDROLA/6,75 OB 20121215	15/12/2012	6,750	6,07
IBERDROLA, S.A.	ES0274760075	SALTOS.SIL/6,75 OB 20101101	01/11/2010	6,750	6,05
IBERDROLA, S.A.	ES0274760083	SALTOS.SIL/6,75 OB 20121001	01/10/2012	6,750	6,07
LANDESBANK HESSEN-THÜRINGEN	ES0257763005	HELABA/5,60 OB SUBD 20180529	29/05/2018	5,600	617,09
MINICENTRALES DOS, S.A.	ES0264101017	MINICENT.DOS/4,81 OB 20341129	29/11/2034	4,810	187.972,34
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANDO DE HL	ES0264870017	EL.MONTE/VAR OB SUBD PERP		V	1.524,76
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920029	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD PERP		V	613,26
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920045	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD PERP		V	600,88
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920052	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD PERP		V	600,96
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920060	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD 20211018	18/10/2021	V	599,86
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920078	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD 20230610	10/06/2023	V	599,89
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920086	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD 20250608	08/06/2025	V	599,86
MONTE DE PIEDAD Y CAJA GENERAL DE AHORROS DE BADAJOZ	ES0214920094	CA.BADAJOS/VAR OB SUBD 20220615	15/06/2022	V	601,76
TELEFONICA, S.A.	ES0278430931	TEF/4,50 OB 20090414	14/04/2009	4,500	9.951,73
UNIVERSIDAD DE VALENCIA - ESTUDI GENERAL	ES0282102013	UNIV.VAL/5,55 OB 20131215	15/12/2013	5,550	6.010,12
UNIVERSIDAD POLITECNICA DE VALENCIA	ES0282103011	UPV/5,55 OB 20131215	15/12/2013	5,550	6.010,12
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	1.000,01

BONOS

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
AYT BONOS TESORERIA II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0312271002	AYT.BO.TESOR.II/VAR BTA 20130224 A	24/02/2013	V	94.202,58
AYT BONOS TESORERIA II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0312271010	AYT.BO.TESOR.II/VAR BTA 20130224 B	24/02/2013	V	93.354,27
AYT CEAMI EMTN I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312193008	AYT.CEAMI.I/VAR BTA 20111103 GTIA	03/11/2011	V	43.755,00
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACT	ES0312298021	AYT.CCG/3,75 BTA 20221214 XI GTIA	14/12/2022	3,750	73.674,26
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACT	ES0312298054	AYT.CCG/4,00 BTA 20210324 VI GTIA	24/03/2021	4,000	79.652,08
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACT	ES0312298070	AYT.CCG/4,25 BTA 20180614 VIII GTIA	14/06/2018	4,250	89.508,39
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACT	ES0312298096	AYT.CCG/4,25 BTA 20231025 X GTIA	25/10/2023	4,250	78.340,16
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACT	ES0312298104	AYT.CCG/4,00 BTA 20161220 XI GTIA	20/12/2016	4,000	86.569,46
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACT	ES0312298112	AYT.CCG/4,00 BTA 20170321 XII GTIA	21/03/2017	4,000	87.900,00
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACT	ES0312298120	AYT.CCG/4,75 BTA 20270525 XIII GTIA	25/05/2027	4,750	82.581,83
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACT	ES0312298160	AYT.CCG/VAR BTA 20100331 XVII GTIA	31/03/2010	V	99.206,78
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACT	ES0312298187	AYT.CCG/VAR BTA 20131023 XIX GTIA	23/10/2013	V	100.000,00
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACT	ES0312298195	AYT.CCG/VAR BTA 20151124 XX GTIA	24/11/2015	V	100.000,00
AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FONDO DE TITULIZACION DE ACT	ES0312298203	AYT.CCG/4,00 BTA 20111229 XXI GTIA	29/12/2011	4,000	100.553,12
AYT CEDULAS CAJAS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361002001	AYT.CED.CA.III/5,25 BTA 20120628	28/06/2012	5,250	97.763,43
AYT CEDULAS CAJAS IV, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312368006	AYT.CED.CA.IV/4,00 BTA 20130313	13/03/2013	4,000	91.439,60
AYT CEDULAS CAJAS IX, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312358007	AYT.CED.CA.IX/3,75 BTA 20150331 A	31/03/2015	3,750	91.310,14
AYT CEDULAS CAJAS IX, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312358015	AYT.CED.CA.IX/4,00 BTA 20200331 B	31/03/2020	4,000	81.327,39
AYT CEDULAS CAJAS V, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370148019	AYT.CED.CA.V/4,75 BTA 20181204 B	04/12/2018	4,750	89.920,20
AYT CEDULAS CAJAS VI, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312360003	AYT.CED.CA.VI/4,00 BTA 20140407 A	07/04/2014	4,000	92.493,00
AYT CEDULAS CAJAS VII, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312361001	AYT.CED.CA.VII/4,00 BTA 20110623	23/06/2011	4,000	97.613,77
AYT CEDULAS CAJAS VIII, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312362017	AYT.CED.CA.VIII/4,25 BTA 20191118 B	18/11/2019	4,250	87.334,15
AYT CEDULAS CAJAS X, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312342019	AYT.CED.CA.X/3,75 BTA 20250630 B	30/06/2025	3,750	73.444,05
AYT CEDULAS CAJAS, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0352961009	AYT.CED.CA/5,25 BTA 20110420	20/04/2011	5,250	100.206,69
AYT COLATERALES GLOBAL HIPOTECARIO, F.T.A.	ES0312273362	COLAT.GLB.HIP./VAR BTA 20430602 A	02/06/2043	V	80.387,74
AYT FONDO EOLICO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312376009	AYT.EOLICO/VAR BTA 20141125 E1 GTIA	25/11/2014	V	492,68
AYT FONDO EOLICO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312376017	AYT.EOLICO/VAR BTA 20161229 E2 GTIA	29/12/2016	V	493,49
AYT FTPYME II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312363007	AYT.FTPYME.II/VAR BTA 20321020 F1	20/10/2032	V	10.986,95
AYT GENOVA HIPOTECARIO IV, FONDO DE TITULIZACION HIPOTE	ES0370150015	AYT.GEN.H.IV/VAR BTH 20360516 B	16/05/2036	V	88.423,35
AYT GENOVA HIPOTECARIO IX, FONDO DE TITULIZACION HIPOTE	ES0312300033	AYT.GEN.H.IX/VAR BTH 20390715 C	15/07/2039	V	38.995,40
AYT GENOVA HIPOTECARIO VIII, FONDO DE TITULIZACION HIPOTE	ES0312344015	AYT.GEN.H.VIII/VAR BTH 20390515 A2	15/05/2039	V	44.467,78
AYT HIPOTECARIO MIXTO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0370151005	AYT.HIP.MIX.II/VAR BTA 20360620 PH1	20/06/2036	V	45.772,61
AYT HIPOTECARIO MIXTO III, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0312378005	AYT.HIP.MIX.III/VAR BTA 20380321 A	21/03/2038	V	38.191,17
AYT HIPOTECARIO MIXTO IV, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0370152003	AYT.HIP.MIX.IV/VAR BTA 20400120 A	20/01/2040	V	58.629,40
AYT HIPOTECARIO MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312371000	AYT.HIP.MIX/VAR BTA 20330915 A GTIA	15/09/2033	V	27.655,75
AYT KUTXA HIPOTECARIO II, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0370154009	KUTXA.HIP.II/VAR BTA 20561015 A	15/10/2056	V	76.033,68
AYT PRESTAMOS CONSUMO III, FONDO DE TITULIZACION DE ACT	ES0312372008	AYT.PREST.C.III/VAR BTA 20210115 A	15/01/2021	V	97.512,67
AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS II, FONDO DE TITULIZACION	ES0356850000	AYT.INMO.II/VAR BTA 20401210 1 GTIA	10/12/2040	V	18.148,62
AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS III, FONDO DE TITULIZACION	ES0312379003	AYT.INMO.III/VAR BTA 20461215 A	15/12/2046	V	38.018,54
AYT PROMOCIONES INMOBILIARIAS IV, FONDO DE TITULIZACION	ES0312380001	AYT.INMO.IV/VAR BTA 20371015 1 GTIA	15/10/2037	V	21.232,23
BANCAJA 10, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312872023	BANCAJA10/VAR BTA 20500522 A3 GTIA	22/05/2050	V	99.413,02
BANCAJA 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312867015	BANCAJA.11/VAR BTA 20500427 A2 GTIA	27/04/2050	V	92.740,00
BANCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0312883004	BANCAJA.4/VAR BTH 20340618 A	18/06/2034	V	27.797,14
BANCAJA 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312885017	BANCAJA.6/VAR BTA 20360220 A2 GTIA	20/02/2036	V	31.041,69
BANCAJA 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0312885025	BANCAJA.6/VAR BTA 20360220 B GTIA	20/02/2036	V	70.990,50
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211130	BBVA/VAR BO 20090226	26/02/2009	V	99.899,29
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0313211213	BBVA/VAR BO 20110622	22/06/2011	V	48.890,00
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0300230051	BCO.CTO.LOCAL/VAR BO 20090224	24/02/2009	V	99.826,50
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860092	SAB/VAR BO 20100920	20/09/2010	V	97.355,00
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0313860126	SAB/VAR BO 20090707	07/07/2009	V	99.033,07
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0313440119	BTO/VAR BO 20090610	10/06/2009	V	99.410,30
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0313580112	GUI/5,75 BO SUBD 20090415	15/04/2009	5,750	599,85
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0313580120	GUI/VAR BO 20110321	21/03/2011	V	93.170,00
BANCO PASTOR, S.A.	ES0313770069	PAS/VAR BO 20100121	21/01/2010	V	94.453,56
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0313260053	BCH/VAR BO SUBD 20110527	27/05/2011	V	6,65
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0313900344	SAN/VAR BO 20090316	16/03/2009	V	99.487,06
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0313540025	BBE/VAR BO 20100222	22/02/2010	V	97.783,25
BANKINTER 10, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313529010	BKT.10/VAR BTA 20430621 A2 GTIA	21/06/2043	V	60.217,39
BANKINTER 11, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313714018	BKT.11/VAR BTH 20480821 A2 GTIA	21/08/2048	V	67.704,63
BANKINTER 2 PYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313716013	BKT.2.PYME/VAR BTA 20430516 A2 GTIA	16/05/2043	V	58.439,78
BANKINTER 5, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0313920003	BKT.5/VAR BTH 20391112 A GTIA	12/11/2039	V	39.070,72
BANKINTER 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313814016	BKT.9/VAR BTA 20420716 A2P GTIA	16/07/2042	V	62.565,28
BANKINTER 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313814057	BKT.9/VAR BTA 20420716 A2T GTIA	16/07/2042	V	66.680,74
BANKINTER, S.A.	ES0313679427	BKT/VAR BO 20101118	18/11/2010	V	97.676,10
BBVA CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0333763003	BBVA.CONSUMO.1/VAR BTA 20200120 A	20/01/2020	V	76.606,91
BBVA CONSUMO 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313956007	BBVA.CONSUMO.2/VAR BTA 20201220 A	20/12/2020	V	89.159,36
BBVA FINANZIA AUTOS 1 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0313958003	FINAZ.AUTOS.1/VAR BTA 20210426 A	26/04/2021	V	84.165,23
BBVA HIPOTECARIO 3, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0314227010	BBVA.HIP.3/VAR BTA 20381121 A2 GTIA	21/11/2038	V	56.603,24
BBVA LEASING 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314209018	BBVA.LEASING.1/VAR BTA 20310526 A2	26/05/2031	V	99.497,94
BBVA RMBS 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314147010	BBVA.RMBS1/VAR BTA 20500619 A2 GTIA	19/06/2050	V	90.649,59
BBVA RMBS 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0314148059	BBVA.RMBS2/VAR BTA 20500917 C GTIA	17/09/2050	V	81.103,18
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467043	BBVA.SR.FIN/CUPCER BOESTR 20111024	24/10/2011	C	49.750,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467050	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20111121 6	21/11/2011	V	48.500,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467068	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20111121 7	21/11/2011	V	48.500,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467076	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20111121 8	21/11/2011	V	48.500,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467084	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20091127 9	27/11/2009	V	50.000,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467092	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20111128 10	28/11/2011	V	48.360,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467100	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20111128 11	28/11/2011	V	48.500,00
BBVA SENIOR FINANCE, S.A. UNIPERSONAL	ES0325467118	BBVA.SR.FIN/VAR BOESTR 20111219 12	19/12/2011	V	49.137,50
BBVA-3 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0310110004	BBVA3.PYME/VAR BTA 20280421 A1 GTIA	21/01/2029	V	3.083,99
BBVA-5 FTPYME, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370459002	BBVA5.PYME/VAR BTA 20390315 A1 GTIA	15/03/2039	V	39.443,04
BBVA-6 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0370460000	BBVA6.PYME/VAR BTA 20460322 A1	22/03/2046	V	58.463,59
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080011	BPEF/VAR BO 20090730	30/07/2009	V	98.777,38
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080052	BPEF/VAR BO 20100526	26/05/2010	V	99.248,11
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080086	BPEF/VAR BO 20110118	18/01/2011	V	96.965,74

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080110	BPEF/VAR BO 20090522	22/05/2009	V	99.366,33
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080144	BPEF/VAR BO 20120208	08/02/2012	V	93.147,39
BPE FINANCIACIONES, S.A.	ES0357080169	BPEF/VAR BO 20100726	26/07/2010	V	96.332,08
CAIXA DE AHORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA DE AHORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA DE AHORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA	ES0314958010	CAIXANOVA/VAR BO 20101123	23/11/2010	V	97.299,15
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840044	CAIXANOVA/VAR BO 20110314	14/03/2011	V	49.737,51
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840051	CA.CATALUNYA/VAR BO 20090622	22/06/2009	V	99.403,58
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840059	CA.CATALUNYA/VAR BO 20091201	01/12/2009	V	98.785,00
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840077	CA.CATALUNYA/VAR BO 20090728	28/07/2009	3,190	98.827,39
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840093	CA.CATALUNYA/VAR BO 20100302	02/03/2010	V	97.157,48
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840101	CA.CATALUNYA/VAR BO 20101006	06/10/2010	V	95.970,00
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0314840110	CA.CATALUNYA/VAR BO 20110718	18/07/2011	V	83.670,88
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0314973035	CA.CATALUNYA/VAR BO 20090216	16/02/2009	V	49.871,55
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES0314966062	CA.SABADELL/VAR BO 20100201	01/02/2010	V	49.948,29
CAIXA PENEDES FT GENCAT 1 TDA, FONDO DE TITULIZACION DE VALORES	ES0318559012	CA.PENEDES/6,50 BO 20100721	21/07/2010	6,500	50.125,34
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES0315424020	PENEDES.GENCAT1/VAR BTA 20491125 A2	25/11/2049	V	99.350,00
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843196	CCM/VAR BO 20101219	19/12/2010	V	50.010,00
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843212	CAIXAGALICIA/3,25 BO 20090902	02/09/2009	3,250	490,83
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0314843220	CAIXAGALICIA/VAR BO 20101129	29/11/2010	V	96.620,02
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES0315530032	CAIXAGALICIA/VAR BO 20090508	08/05/2009	V	49.594,74
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES0315530040	CA.RIOJA/VAR BO 20100315	15/03/2010	V	96.723,84
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES0314600083	CA.RIOJA/VAR BO 20120222	22/02/2012	V	95.654,54
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0314854037	CA.MURCIA/6,00 BO 20100604	04/06/2010	6,000	50.152,08
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0314975006	CAJADUERO/6,625 BO 20100630	30/06/2010	6,625	50.566,25
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0314975014	CA.CANTABRIA/VAR BO 20100406	06/04/2010	V	96.821,78
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES0314975022	CA.CANTABRIA/VAR BO 20110330	30/03/2011	V	47.700,27
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA	ES0314977101	CA.CANTABRIA/VAR BO 20120412	12/04/2012	V	47.392,09
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA	ES0314977119	BANCAJA/3,95 BO 20110430	30/04/2011	3,950	600,39
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA	ES0314977168	BANCAJA/3,95 BO 20110601	01/06/2011	3,950	600,00
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA	ES0314977200	BANCAJA/VAR BO 20100110	10/01/2010	V	601,47
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA	ES0314977218	BANCAJA/VAR BO 20090227	27/02/2009	V	9.938,00
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA	ES0314977242	BANCAJA/VAR BO 20100225	25/02/2010	V	96.007,19
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BANCAJA	ES0314977259	BANCAJA/VAR BO 20110510	10/05/2011	V	90.837,87
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0315308157	BANCAJA/VAR BO 20120124	24/01/2012	V	90.733,14
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES0315308165	CA.VITAL/VAR BO 20090403	03/04/2009	V	100.000,00
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400047	CA.VITAL/VAR BO 20090924	24/09/2009	V	99.952,73
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400054	CAM/VAR BO 20090615	15/06/2009	V	100.000,00
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400070	CAM/VAR BO 20100114	14/01/2010	V	94.700,00
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0314400088	CAM/VAR BO 20120515	15/05/2012	V	1.000,08
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0314910037	CAM/VAR BO 20120412	12/04/2012	V	99.988,27
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES0314926009	CA.AVILA/VAR BO 20101029	29/10/2010	V	50.005,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES03364730004	SA.NOSTRA/6,50 BO 20100728	28/07/2010	6,500	50.177,67
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950074	CAJASUR/VAR BO 20100118	18/01/2010	V	49.922,82
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950140	CA.MADRID/4,9089 BO SUBD 20100406	06/04/2010	4,909	592,25
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950157	CA.MADRID/4,00 BO 20090211	11/02/2009	4,000	993,46
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950181	CA.MADRID/VAR BO 20090331	31/03/2009	V	991,13
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950249	CA.MADRID/VAR BO 20090810	10/08/2009	V	989,11
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950256	CA.MADRID/CUPCER BO 20090217	17/02/2009	C	877,74
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950264	CA.MADRID/VAR BO 20090217	17/02/2009	V	934,79
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950298	CA.MADRID/VAR BO 20090223	23/02/2009	V	99.686,70
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950306	CA.MADRID/VAR BO 20090629	29/06/2009	V	49.588,45
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950348	CA.MADRID/4,25 BO 20120626	26/06/2012	4,250	990,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950363	CA.MADRID/5,125 BO 20110411	11/04/2011	5,125	49.406,55
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950397	CA.MADRID/VAR BO 20100625	25/06/2010	V	49.386,62
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950413	CA.MADRID/VAR CREC BO 20101015	15/10/2010	V	50.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0314950439	CA.MADRID/5,835 BO 20091022	22/10/2009	5,835	49.985,69
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON	ES0314954050	CA.MADRID/VAR BO 20100622	22/06/2010	V	50.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGON	ES0314954068	IBERCAJA/VAR BO 20090203	03/02/2009	V	99.757,23
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0314970015	IBERCAJA/VAR BO 20110209	09/02/2011	V	95.446,67
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0314970031	LACAIXA/VAR BO 20090302	02/03/2009	V	99.666,96
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0315474389	LACAIXA/VAR BO 20091120	20/11/2009	V	99.162,55
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0315474405	CA.ESPAÑA/VAR BO 20090818	18/08/2009	V	987,15
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0315474439	CA.ESPAÑA/VAR BO 20100330	30/03/2010	V	973,55
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0315474447	CA.ESPAÑA/VAR BO 20091019	19/10/2009	V	49.493,47
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES0314982010	CA.ESPAÑA/VAR BO 20121122	22/11/2012	V	988,85
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES0314983026	CA.GRANADA/6,625 BO 20100714	14/07/2010	6,625	50.215,07
CAJA LABORAL POPULAR COOP. DE CREDITO	ES0315306003	LA.CAJA/VAR BO 20100915	15/09/2010	V	47.942,05
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0314601016	LA.CAJA/7,00 BO 20100707	07/07/2010	7,000	50.460,68
CAP-TDA 1, FONDO DE TITULIZACION DE VALORES	ES0315911000	CA.LABORAL/VAR BO 20090713	13/07/2009	V	49.525,00
CEDULAS TDA 12, FONDO DE TITULIZACION DE VALORES	ES0318825009	CR.NAVARRA/VAR BO 20111124	24/11/2011	V	44.199,12
CEDULAS TDA 2, FONDO DE TITULIZACION DE VALORES	ES0317019000	CAJAMAR/VAR BO 20110714	14/07/2011	V	49.682,19
CEDULAS TDA 3, FONDO DE TITULIZACION DE VALORES	ES0317043000	CAP-TDA.1/VAR BTA 20130912 GTIA	12/09/2013	V	97.245,00
CEDULAS TDA 4, FONDO DE TITULIZACION DE VALORES	ES0317044008	CED.TDA.12/VAR BTA 20110626 A GTIA	26/06/2011	V	46.393,33
CEDULAS TDA 6, FONDO DE TITULIZACION DE VALORES	ES0317046003	CED.TDA.24,50 BTA 20131126 GTIA	26/11/2013	4,500	97.280,21
CEDULAS TDA 9, FONDO DE TITULIZACION DE VALORES	ES0317048009	CED.TDA.3/4,38 BTA 20160303 1 GTIA	03/03/2016	4,375	90.415,00
DOGI INTERNATIONAL FABRICS, S.A.	ES0326962000	CED.TDA.4/3,63 BTA 20090616 GTIA	16/06/2009	3,625	98.949,23
EMPRESAS HIPOTECARIO TDA CAM 3, FONDO DE TITULIZACION DE VALORES	ES0330876014	CED.TDA.6/3,88 BTA 20250523 GTIA	23/05/2025	3,875	74.619,39
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES0330991003	CED.TDA.9/VAR BTA 20101130 A GTIA	30/11/2010	V	46.138,49
F.T.A. PROGRAMA INDEPENDIENTE DE TITULIZACION DE VALORES	ES0334699008	DGI/5,00 BO CONV 20110125	25/01/2011	5,000	2,41
FONCAIXA FTGENCAT 4, FONDO DE TITULIZACION DE VALORES	ES0338013016	TDA.CAM.3/VAR BTA 20400128 A2 GTIA	28/01/2040	V	86.100,24
FONDO DE TITULIZACION DE VALORES SANTANDER AUTO 1	ES0382040006	ELE.CAP/VAR BO 20120705	05/07/2012	V	48.441,29
FONDO DE TITULIZACION DE VALORES SANTANDER CONSUMER	ES0338057005	PRG.IND.CED.HIP/5,125 BTA 20220720	20/07/2022	5,125	93.724,46
FONDO DE TITULIZACION DE VALORES SANTANDER FINANCIACION	ES0382043000	FONCAIXA.GCAT.4/VAR BTA 20490310 AG	10/03/2049	V	97.211,00
		SAN.AUTO1/VAR BTA 20211125 GTIA	25/11/2021	V	25.625,68
		SAN.CONS.AUTO06/VAR BTA 20161020 A	20/10/2016	V	77.819,95
		SAN.FINAN.1/VAR BTA 20350720 A GTIA	20/07/2035	V	57.495,23

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 11	ES0338340005	UCI.11/VAR BTA 20410915 A GTIA	15/09/2041	V	30.276,67
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS UCI 14	ES0338341003	UCI.14/VAR BTA 20430620 A GTIA	20/06/2043	V	52.372,80
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, SANTANDER EMPRESAS	ES0382041012	SAN.EMPR.1/VAR BTA 20381104 A2 GTIA	04/11/2038	V	56.290,67
FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS, SANTANDER EMPRESAS	ES0337710018	SAN.EMPR.3/VAR BTA 20491016 A2 GTIA	16/10/2049	V	70.709,41
FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA UCI 12	ES0338147004	UCI.12/VAR BTH 20391215 A GTIA	15/12/2039	V	45.924,28
FTPYME BANCAJA 2 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339751028	PYME.BANCAJA.2/VAR BTA 20300115 A3G	15/01/2030	V	41.075,43
FTPYME BANCAJA 3 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0304501028	PYME.BANCAJA.3/VAR BTA 20371213 A3G	13/12/2037	V	89.409,20
FTPYME BANCAJA 4 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339731020	PYME.BANCAJA.4/VAR BTA 20380724 A3G	24/07/2038	V	82.711,18
FTPYME TDA 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339741003	FTPYME.TDA.5/VAR BTA 20371026 1SA	26/10/2037	V	6.305,80
FTPYME TDA CAM 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0339759013	PYME.TDA.CAM.4/VAR BTA 20450928 A2	28/09/2045	V	65.879,09
GAT FTGENCAT 2007, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0341081026	GAT.GENCAT.07/VAR BTA 20491215 B	15/12/2049	V	66.150,00
GAT FTGENCAT 2007, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0341081034	GAT.GENCAT.07/VAR BTA 20491215 C	15/12/2049	V	54.899,00
GAT FTGENCAT 2007, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0341081042	GAT.GENCAT.07/VAR BTA 20491215 D	15/12/2049	V	46.052,50
GAT FTGENCAT 2008, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0341071027	GAT.GENCAT.08/VAR BTA 20480128 B	28/01/2048	V	61.286,50
GAT FTGENCAT 2008, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0341071043	GAT.GENCAT.08/VAR BTA 20480128 D	28/01/2048	V	43.801,00
GC FTGENCAT CAIXA SABADELL 2, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0341072017	GC.CAIXA.SAB.2/VAR BTA 20471130 AG	30/11/2047	V	99.940,00
HIPOCAT 10, F.T.A.	ES0345671012	HIPOCAT 10/VAR BTA 203891024 A2 GTIA	24/10/2038	V	70.159,11
HIPOCAT 10, F.T.A.	ES0345671038	HIPOCAT 10/VAR BTA 20120424 A4 GTIA	24/04/2012	V	92.437,99
HIPOCAT 11, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345672010	HIPOCAT.11/VAR BTA 20500115 A2 GTIA	15/01/2050	V	84.530,96
HIPOCAT 5, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0344264009	HIPOCAT.5/VAR BTA 20331130 A GTIA	30/11/2033	V	27.396,09
HIPOCAT 7, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345783015	HIPOCAT 7/VAR BTA 20380715 A2 GTIA	15/07/2038	V	46.004,84
HIPOCAT 8, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0345784013	HIPOCAT 8/VAR BTA 20380315 A2 GTIA	15/03/2038	V	61.892,52
IM BANCO POPULAR FTPYME 1, FONDO DE TITULIZACION DE AC	ES0347847008	IM.POP.PYME/VAR BTA 20430424 A	24/04/2043	V	8.945,96
IM CEDULAS 12, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347567002	IM.CED.12/4,50 BTA 20091121 GTIA	21/11/2009	4,500	99.589,00
IM CEDULAS 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0347785000	IM.CED.9/4,25 BTA 20160609 GTIA	09/06/2016	4,250	91.959,00
IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 1, FONDO DE TITULIZAC	ES0347843015	IM.POP.EMP.1/VAR BTA 20330321 A2	21/03/2033	V	67.463,14
IM GRUPO BANCO POPULAR EMPRESAS 2, FONDO DE TITULIZAC	ES0349047003	IM.POP.EMP.2/VAR BTA 20441124 A	24/11/2044	V	100.000,00
IM GRUPO BANCO POPULAR FTPYME I FONDO DE TITULIZACION	ES0347844021	IM.POP.PYME.I/VAR BTA 20390921 A3	21/09/2039	V	64.132,31
IM PASTOR 2, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0347861009	IM PASTOR 2/VAR BTH 20410922 A GTIA	22/09/2041	V	42.957,42
IM PASTOR 3, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0347862007	IM.PAS.3/VAR BTH 20430322 A GTIA	22/03/2043	V	42.918,01
IM PRESTAMOS FONDOS CEDULAS, FONDO DE TITULIZACION DE	ES0347787014	IM.PREST.F.CED./VAR BTA 20220124 B	24/01/2022	V	91.020,50
IM TERRASSA 1 FTGENCAT FTA	ES0347863039	IM.TERR.1/VAR BTA 20500424 C GTIA	24/04/2050	V	94.241,51
IM TERRASSA 1 FTGENCAT FTA	ES0347863047	IM.TERR.1/VAR BTA 20500424 D GTIA	24/04/2050	V	89.611,87
INTERMONEY MASTER CEDULAS, FONDO DE TITULIZACION DE A	ES0362859003	INTER.MAST.CED/3,50 BTA 20151202 M1	02/12/2015	3,500	89.596,39
MADRID RMBS I, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359091008	MADRID.RMBS.I/VAR BTA 20490622 A1	22/06/2049	V	16.580,14
MADRID RMBS III FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0359093012	MADRID.RMBS.III/VAR BTA 20500222 A2	22/02/2050	V	78.305,54
MBS BANCAJA 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361795000	MBS.BANCAJA.2/VAR BTA 20380225 A	25/02/2038	V	43.203,79
MBS BANCAJA 4, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0361797014	MBS.BANCAJA.4/VAR BTA 20500723 A2	23/07/2050	V	95.020,00
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANDO DE HL	ES0358197004	CAJASOL/6,75 BO 20100714	14/07/2010	6,750	50.777,40
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES0364872012	UNICAJA/VAR BO 20090323	23/03/2009	V	99.585,00
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES0364872038	UNICAJA/VAR BO 20110726	26/07/2011	V	47.130,00
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES0364872087	UNICAJA/5,375 BO 20100521	21/05/2010	5,375	50.157,88
PROGRAMA CEDULAS TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIV	ES0371622020	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20310410 A6	10/04/2031	4,250	78.690,28
PROGRAMA CEDULAS TDA, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIV	ES0371622046	PROG.CED.TDA/4,25 BTA 20270328 A5	28/03/2027	4,250	84.360,07
PYME VALENCIA 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0372241010	PYME.VALENCIA1/VAR BTA 20400323 A2	23/03/2040	V	71.942,96
RURAL HIPOTECARIO IX, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0374274019	RURAL.HIP.IX/VAR BTA 20500217 A2	17/02/2050	V	89.656,75
RURAL HIPOTECARIO V FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0358284000	RURAL.HIP.V/VAR BTH 20350315 A1	15/03/2035	V	34.702,39
RURAL HIPOTECARIO VII, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0366366005	RURAL.HIP.VII/VAR BTA 20380315 A1	15/03/2038	V	40.790,22
RURALPYME 1 FTPYME FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0374351007	RURALPYME.1/VAR BTA 20351221 A1	21/12/2035	V	768,55
SANTANDER EMISORA 150, S.A. UNIPERSONAL	ES0307779001	SAN.EMISORA.150/VAR BO 20121004	04/10/2012	V	2.906,00
TDA 11, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0378014031	TDA.11/VAR BTH 20120726 B GTIA	26/07/2012	V	97.908,65
TDA 12, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0377976024	TDA.12/VAR BTH 20300426 A3 GTIA	26/04/2030	V	27.371,33
TDA 16 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377973021	TDA.16-MIXT/VAR BTA 20350322 A2 GTIA	22/06/2035	V	30.325,67
TDA 18 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377989001	TDA.18-MIXTO/VAR BTA 20450622 A1	22/03/2045	V	34.913,98
TDA 22 - MIXTO, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377983012	TDA.22-MIXTO/VAR BTA 20460628 A1B	28/06/2046	V	89.096,08
TDA 27, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377954013	TDA.27/VAR BTA 20501228 A2 GTIA	28/12/2050	V	95.589,80
TDA 7, FONDO DE TITULIZACION HIPOTECARIA	ES0308184029	TDA.7/VAR BTH 20281117 A3 GTIA	17/11/2028	V	17.884,83
TDA CAJAMAR 2, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377965019	TDA.CAJAMAR.2/VAR BTA 20410626 A2	26/06/2041	V	51.342,53
TDA CAM 6, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377993011	TDA.CAM.6/VAR BTA 20160428 A2 GTIA	28/04/2016	V	99.985,95
TDA CAM 9, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377955002	TDA.CAM.9/VAR BTA 20500428 A1 GTIA	28/04/2050	V	76.793,43
TDA PASTOR 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS	ES0377980000	TDA PASTOR 1/VAR BTA 20381228 A1	28/12/2038	V	26.217,46
TDA PASTOR CONSUMO 1, FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVO	ES0338454004	PASTOR.CONS.1/VAR BTA 20210128 A	28/01/2021	V	87.129,74

CEDULAS

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211006	BBVA/5,50 CEDHIP 20091015 GTIA	15/10/2009	5,500	101.486,71
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211014	BBVA/5,75 CEDHIP 20100927 GTIA	27/09/2010	5,750	102.720,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211030	BBVA/4,25 CEDHIP 20103129 GTIA	29/01/2013	4,250	97.344,60
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211048	BBVA/3,50 CEDHIP 20110315 GTIA	15/03/2011	3,500	98.748,28
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211055	BBVA/4,25 CEDHIP 20104715 GTIA	15/07/2014	4,250	99.723,17
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211063	BBVA/3,00 CEDHIP 20091203 GTIA	03/12/2009	3,000	98.904,93
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211071	BBVA/4,00 CEDHIP 20250225 GTIA	25/02/2025	4,000	86.092,51
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211089	BBVA/3,50 CEDHIP 20150225 GTIA	25/02/2015	3,500	97.139,20
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211097	BBVA/2,75 CEDHIP 20100607 GTIA	07/06/2010	2,750	97.667,45
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211105	BBVA/3,50 CEDHIP 20201007 GTIA	07/10/2020	3,500	85.303,55
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211121	BBVA/3,50 CEDHIP 20210124 GTIA	24/01/2021	3,500	87.817,74
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211139	BBVA/3,875 CEDHIP 20120531 GTIA	31/05/2012	3,875	98.651,69
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211154	BBVA/3,75 CEDHIP 20131004 GTIA	04/10/2013	3,750	97.229,25
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211162	BBVA/3,75 CEDTER 20111123 GTIA	23/11/2011	3,750	98.440,38
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211170	BBVA/4,25 CEDHIP 20170118 GTIA	18/01/2017	4,250	97.102,41
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0413211204	BBVA/4,50 CEDTER 20140530 GTIA	30/05/2014	4,500	50.714,79
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0424207001	ARGENTARIA/4,375 CEDHIP 20090405	05/04/2009	4,375	99.915,00
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0400230001	BCO.CTO.LOCAL/3,75 CEDTER 20100407	07/04/2010	3,750	99.069,38
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0400230019	BCO.CTO.LOCAL/3,75 CEDTER 20090630	30/06/2009	3,750	99.641,95
BANCO DE CREDITO LOCAL DE ESPAÑA, S.A.	ES0400230068	BCO.CTO.LOCAL/3,75 CEDTER 20111020	20/10/2011	3,750	99.050,60
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860000	SAB/4,50 CEDHIP 20130429 GTIA	29/04/2013	4,500	100.378,08
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860026	SAB/3,25 CEDHIP 20150615 GTIA	15/06/2015	3,250	92.483,17
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860042	SAB/4,125 CEDHIP 20160510 GTIA	10/05/2016	4,125	97.382,21
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0413860109	SAB/5,00 CEDHIP 20100509 GTIA	09/05/2010	5,000	101.018,08
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440027	BTO/5,75 CEDHIP 20170327 GTIA	27/03/2017	5,750	101.499,00
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440035	BTO/4,00 CEDHIP 20100512 GTIA	12/05/2010	4,000	99.494,15
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440043	BTO/3,75 CEDHIP 20110223 GTIA	23/02/2011	3,750	98.358,84
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440050	BTO/4,25 CEDHIP 20140916 GTIA	16/09/2014	4,250	99.441,76
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440076	BTO/2,75 CEDHIP 20120907 GTIA	07/09/2012	2,750	94.107,34
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0413440084	BTO/3,50 CEDHIP 20160118 GTIA	18/01/2016	3,500	92.965,00
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0413580012	GUI/VAR CEDHIP 20111209 GTIA	09/12/2011	V	99.995,36
BANCO PASTOR, S.A.	ES0413770050	PAS/6,00 CEDHIP 20100621 GTIA	21/06/2010	6,000	102.825,59
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0413790017	POP/4,00 CEDHIP 20161018 GTIA	18/10/2016	4,000	95.825,00
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900038	SAN/4,00 CEDHIP 20100910 GTIA	10/09/2010	4,000	99.265,30
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900061	SAN/4,50 CEDHIP 20160729 GTIA	29/07/2016	4,500	98.110,84
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900079	SAN/3,25 CEDHIP 20120207 GTIA	07/02/2012	3,250	97.279,75
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900095	SAN/2,50 CEDHIP 20110128 GTIA	28/01/2011	2,500	95.982,13
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900103	SAN/3,125 CEDHIP 20150928 GTIA	28/09/2015	3,125	87.647,00
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900111	SAN/3,50 CEDHIP 20140206 GTIA	06/02/2014	3,500	96.459,31
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900129	SAN/3,875 CEDHIP 20260206 GTIA	06/02/2026	3,875	83.285,00
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900137	SAN/3,75 CEDHIP 20110908 GTIA	08/09/2011	3,750	98.494,09
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900145	SAN/4,125 CEDHIP 20170109 GTIA	09/01/2017	4,125	96.759,09
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900152	SAN/4,25 CEDHIP 20130506 GTIA	06/05/2013	4,250	98.531,32
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900160	SAN/4,625 CEDHIP 20270504 GTIA	04/05/2027	4,625	91.025,00
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0413900178	SAN/4,50 CEDHIP 20121114 GTIA	14/11/2012	4,500	100.269,25
BANKINTER, S.A.	ES0413679020	BKT/5,00 CEDHIP 20100514 GTIA	14/05/2010	5,000	50.519,15
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0414840274	CA.CATALUNYA/3,50 CEDHIP 20160307	07/03/2016	3,500	87.025,00
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0414840381	CA.CATALUNYA/5,00 CEDHIP 20100519	19/05/2010	5,000	100.425,25
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES0414843179	CAIXAGALICIA/5,25 CEDHIP 20100526	26/05/2010	5,250	50.112,43
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0414854010	CAJADUERO/VAR CEDHIP 20091029 GTIA	29/10/2009	V	997,84
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0414854028	CAJADUERO/VAR CEDHIP 20091229 GTIA	29/12/2009	V	996,14
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0414854036	CAJADUERO/VAR CEDHIP 20120629 GTIA	29/06/2012	V	995,12
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0414854044	CAJADUERO/VAR CEDHIP 20120929 GTIA	29/09/2012	V	998,19
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0414977282	BANCAJA/5,25 CEDHIP 20091106 GTIA	06/11/2009	5,250	99.895,00
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0414977290	BANCAJA/5,50 CEDHIP 20110119 GTIA	19/01/2011	5,500	99.832,00
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0414977308	BANCAJA/5,50 CEDHIP 20111107 GTIA	05/11/2011	5,500	99.698,00
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0414400038	CAM/6,125 CEDHIP 20100625 GTIA	25/06/2010	6,125	102.541,22
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950586	CA.MADRID/5,25 CEDHIP 20120301 GTIA	01/03/2012	5,250	102.000,00
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950594	CA.MADRID/5,00 CEDHIP 20141030 GTIA	30/10/2014	5,000	100.535,62
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950602	CA.MADRID/3,75 CEDHIP 20091022 GTIA	22/10/2009	3,750	99.467,68
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950610	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20110325 GTIA	25/03/2011	3,500	96.358,48
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950628	CA.MADRID/4,00 CEDHIP 20250203 GTIA	03/02/2025	4,000	85.749,98
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950636	CA.MADRID/3,50 CEDHIP 20151214 GTIA	14/12/2015	3,500	89.556,80
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950644	CA.MADRID/4,125 CEDHIP 20360324	24/03/2036	4,125	45.776,71
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950651	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20180525 GTIA	25/05/2018	4,250	48.888,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950669	CA.MADRID/4,25 CEDHIP 20160705 GTIA	05/07/2016	4,250	47.601,75
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0414950685	CA.MADRID/4,50 CEDHIP 20220426 GTIA	26/04/2022	4,500	47.538,17
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970139	LACAIXA/5,25 CEDHIP 20110405 GTIA	05/04/2011	5,250	101.580,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970162	LACAIXA/4,50 CEDHIP 20121121 GTIA	21/11/2012	4,500	99.824,32
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970170	LACAIXA/3,50 CEDHIP 20100301 GTIA	01/03/2010	3,500	98.779,99
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970188	LACAIXA/4,25 CEDHIP 20131031 GTIA	31/10/2013	4,250	99.463,26
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970196	LACAIXA/4,75 CEDHIP 20181031 GTIA	31/10/2018	4,750	99.159,52
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970204	LACAIXA/3,875 CEDHIP 20250217 GTIA	17/02/2025	3,875	83.207,47
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970212	LACAIXA/3,25 CEDHIP 20151005 GTIA	05/10/2015	3,250	88.804,22
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970238	LACAIXA/3,375 CEDHIP 20140630 GTIA	30/06/2014	3,375	47.453,06
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970246	LACAIXA/3,625 CEDHIP 20210118 GTIA	18/01/2021	3,625	42.262,50
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970253	LACAIXA/VAR CEDHIP 20160630 GTIA	30/06/2016	V	999,99
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970295	LACAIXA/4,25 CEDHIP 20170126 GTIA	26/01/2017	4,250	48.165,83
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970303	LACAIXA/4,50 CEDHIP 20220126 GTIA	26/01/2022	4,500	45.933,40
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970311	LACAIXA/3,75 CEDTER 20110913 GTIA	13/09/2011	3,750	49.036,15
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970337	LACAIXA/VAR CEDHIP 20160930 GTIA	30/09/2016	V	999,99
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970352	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170330 GTIA	30/03/2017	V	999,99
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970394	LACAIXA/VAR CEDHIP 20170930 GTIA	30/09/2017	V	999,99
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0414970402	LACAIXA/4,625 CEDHIP 20190604 GTIA	04/06/2019	4,625	47.533,25
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	49.994,41
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0414981219	CAJACANARIAS/VAR CEDHIP 20090618	18/06/2009	V	398,55
DEXIA SABADELL, S.A.	ES0426396075	DEXIA.SAB/VAR CEDTER 20110222 GTIA	22/02/2011	V	99.476,64
DEXIA SABADELL, S.A.	ES0426396083	DEXIA.SAB/VAR CEDTER 20110227 GTIA	27/02/2011	V	99.534,86
DEXIA SABADELL, S.A.	ES0426396117	DEXIA.SAB/VAR CEDTER 20100228 GTIA	28/02/2010	V	99.539,65
DEXIA SABADELL, S.A.	ES0426396125	DEXIA.SAB/VAR CEDTER 20101008 GTIA	08/10/2010	V	99.984,73

PAGARÉS

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845671	ABE/PAG 20090113	13/01/2009	C	99.318,90
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845697	ABE/PAG 20090122	22/01/2009	C	98.738,74
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845705	ABE/PAG 20090205	05/02/2009	C	99.116,69
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845713	ABE/PAG 20091106	06/11/2009	C	95.386,43
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845721	ABE/PAG 20091111	11/11/2009	C	95.520,11
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845754	ABE/PAG 20090518	18/05/2009	C	97.862,77
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845762	ABE/PAG 20090220	20/02/2009	C	98.944,81
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845770	ABE/PAG 20090603	03/06/2009	C	98.071,80
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845788	ABE/PAG 20091209	09/12/2009	C	96.283,57
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845796	ABE/PAG 20090610	10/06/2009	C	98.176,47
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845804	ABE/PAG 20091210	10/12/2009	C	96.327,79
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845812	ABE/PAG 20091216	16/12/2009	C	96.564,24
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845820	ABE/PAG 20090402	02/04/2009	C	99.119,85
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845838	ABE/PAG 20090622	22/06/2009	C	98.395,64
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0511845846	ABE/PAG 20090922	22/09/2009	C	97.568,33
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040R01	BCA.MARCH/PAG 20090109	09/01/2009	C	996,21
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040RU8	BCA.MARCH/PAG 20090116	16/01/2009	C	986,89
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040RW4	BCA.MARCH/PAG 20090120	20/01/2009	C	993,21
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040SF7	BCA.MARCH/PAG 20090205	05/02/2009	C	987,73
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040SY8	BCA.MARCH/PAG 20090313	13/03/2009	C	992,06
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040VS4	BCA.MARCH/PAG 20090615	15/06/2009	C	983,04
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040WD4	BCA.MARCH/PAG 20090105	05/01/2009	C	991,73
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040WK9	BCA.MARCH/PAG 20090714	14/07/2009	C	982,48
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040X11	BCA.MARCH/PAG 20090220	20/02/2009	C	981,02
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040YA6	BCA.MARCH/PAG 20090330	30/03/2009	C	973,73
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040YB4	BCA.MARCH/PAG 20090403	03/04/2009	C	973,07
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040YI9	BCA.MARCH/PAG 20090123	23/01/2009	C	994,74
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040YJ7	BCA.MARCH/PAG 20091026	26/10/2009	C	965,26
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040YO7	BCA.MARCH/PAG 20090504	04/05/2009	C	976,04
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040ZD7	BCA.MARCH/PAG 20090602	02/06/2009	C	980,35
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040ZJ6	BCA.MARCH/PAG 20090310	10/03/2009	C	992,08
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040ZK4	BCA.MARCH/PAG 20091207	07/12/2009	C	965,72
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040ZN6	BCA.MARCH/PAG 20091211	11/12/2009	C	967,29
BANCA MARCH, S.A.	ES0513040ZP1	BCA.MARCH/PAG 20090324	24/03/2009	C	992,21
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0513141AD6	AND/PAG 20090105	05/01/2009	C	2.975,25
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0513141DB4	AND/PAG 20090529	29/05/2009	C	2.940,67
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0513141P21	AND/PAG 20090116	16/01/2009	C	2.990,98
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0513141R29	AND/PAG 20090220	20/02/2009	C	2.951,13
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0513141S85	AND/PAG 20090327	27/03/2009	C	2.923,61
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0513141X88	AND/PAG 20090605	05/06/2009	C	2.940,47
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860TQ3	SAB/PAG 20090109	09/01/2009	C	991,03
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513860ZS6	SAB/PAG 20090105	05/01/2009	C	987,66
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138610W5	SAB/PAG 20090209	09/02/2009	C	985,04
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138610Y1	SAB/PAG 20090116	16/01/2009	C	993,39
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138611C5	SAB/PAG 20090123	23/01/2009	C	987,95
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138611K8	SAB/PAG 20090130	30/01/2009	C	987,34
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138611O0	SAB/PAG 20090210	10/02/2009	C	988,17
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138611R3	SAB/PAG 20090218	18/02/2009	C	980,78
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138611U7	SAB/PAG 20090216	16/02/2009	C	986,49
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0513861205	SAB/PAG 20090119	19/01/2009	C	985,02
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138612A7	SAB/PAG 20090226	26/02/2009	C	987,58
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138612I0	SAB/PAG 20090310	10/03/2009	C	988,10
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138612N0	SAB/PAG 20090317	17/03/2009	C	984,72
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138612W1	SAB/PAG 20090330	30/03/2009	C	976,74
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138612X9	SAB/PAG 20091005	05/10/2009	C	946,51
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138612Y7	SAB/PAG 20090401	01/04/2009	C	987,34
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138613C1	SAB/PAG 20090403	03/04/2009	C	988,68
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138613F4	SAB/PAG 20090408	08/04/2009	C	984,53
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138613K4	SAB/PAG 20090414	14/04/2009	C	987,26
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138613T5	SAB/PAG 20090430	30/04/2009	C	977,10
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138613W9	SAB/PAG 20090506	06/05/2009	C	972,03
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138614N6	SAB/PAG 20090529	29/05/2009	C	973,29
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138614U1	SAB/PAG 20090605	05/06/2009	C	978,97
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138614Y3	SAB/PAG 20090612	12/06/2009	C	982,68
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138615B8	SAB/PAG 20090619	19/06/2009	C	983,50
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138615X2	SAB/PAG 20090114	14/01/2009	C	985,87
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138616H3	SAB/PAG 20090203	03/02/2009	C	990,47
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138616Y8	SAB/PAG 20090901	01/09/2009	C	972,85
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138617C2	SAB/PAG 20090107	07/01/2009	C	999,04
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138617O7	SAB/PAG 20090924	24/09/2009	C	950,57
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138617W0	SAB/PAG 20090929	29/09/2009	C	954,40
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138617Y6	SAB/PAG 20090126	26/01/2009	C	997,34
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138618C0	SAB/PAG 20090407	07/04/2009	C	973,34
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138618I7	SAB/PAG 20090511	11/05/2009	C	979,51
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138618J5	SAB/PAG 20090427	27/04/2009	C	975,34
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138618O5	SAB/PAG 20090727	27/07/2009	C	963,45
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138619B0	SAB/PAG 20091127	27/11/2009	C	960,43
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138619E4	SAB/PAG 20100120	20/01/2010	C	956,92
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138619G9	SAB/PAG 20090601	01/06/2009	C	979,71
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138619H7	SAB/PAG 20090602	02/06/2009	C	980,63
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138619M7	SAB/PAG 20090319	19/03/2009	C	992,20
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138619O3	SAB/PAG 20091211	11/12/2009	C	967,30
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138619Q8	SAB/PAG 20091207	07/12/2009	C	966,46
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES05138619S4	SAB/PAG 20090615	15/06/2009	C	982,97
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139800M2	BVA/PAG 20090316	16/03/2009	C	989,73

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139800N0	BVA/PAG 20090109	09/01/2009	C	997,50
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139800P5	BVA/PAG 20090115	15/01/2009	C	997,31
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES05139800Q3	BVA/PAG 20090219	19/02/2009	C	994,85
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0513980252	BVA/PAG 20090320	20/03/2009	C	981,12
BANCO ETCHEVERRIA, S.A.	ES05134411N1	BCO.ETCHEVER/PAG 20091016	16/10/2009	C	949,67
BANCO ETCHEVERRIA, S.A.	ES05134411T8	BCO.ETCHEVER/PAG 20090304	04/03/2009	C	990,94
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135807I9	GUI/PAG 20090107	07/01/2009	C	991,27
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135807V2	GUI/PAG 20090102	02/01/2009	C	990,00
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135807X8	GUI/PAG 20090114	14/01/2009	C	988,72
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135807Y6	GUI/PAG 20090121	21/01/2009	C	986,34
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135808A4	GUI/PAG 20090128	28/01/2009	C	988,48
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135808C0	GUI/PAG 20090204	04/02/2009	C	987,50
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135808D8	GUI/PAG 20090210	10/02/2009	C	982,66
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135808F3	GUI/PAG 20090218	18/02/2009	C	980,31
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135808I7	GUI/PAG 20090311	11/03/2009	C	981,50
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135808J5	GUI/PAG 20090318	18/03/2009	C	984,33
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135808L1	GUI/PAG 20090415	15/04/2009	C	973,59
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135808Q0	GUI/PAG 20090505	05/05/2009	C	973,34
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135808W8	GUI/PAG 20090617	17/06/2009	C	983,09
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135809E4	GUI/PAG 20090714	14/07/2009	C	965,82
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135809P0	GUI/PAG 20090819	19/08/2009	C	968,55
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135809Q8	GUI/PAG 20090826	26/08/2009	C	976,60
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135809V8	GUI/PAG 20090929	29/09/2009	C	953,60
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES05135809W6	GUI/PAG 20090330	30/03/2009	C	973,78
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580A00	GUI/PAG 20090930	30/09/2009	C	947,24
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580A18	GUI/PAG 20090407	07/04/2009	C	972,88
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580A26	GUI/PAG 20091007	07/10/2009	C	965,59
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580A42	GUI/PAG 20090427	27/04/2009	C	974,96
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580A83	GUI/PAG 20091202	02/12/2009	C	962,43
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0513580B17	GUI/PAG 20091207	07/12/2009	C	967,24
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770XL7	PAS/PAG 20090119	19/01/2009	C	996,72
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513770ZF4	PAS/PAG 20090515	15/05/2009	C	967,01
BANCO PASTOR, S.A.	ES05137830R0	PAS/PAG 20090417	17/04/2009	C	973,78
BANCO PASTOR, S.A.	ES05137831F3	PAS/PAG 20090528	28/05/2009	C	980,40
BANCO PASTOR, S.A.	ES05137832I5	PAS/PAG 20090105	05/01/2009	C	991,79
BANCO PASTOR, S.A.	ES05137832N5	PAS/PAG 20090715	15/07/2009	C	973,83
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513783474	PAS/PAG 20090220	20/02/2009	C	980,25
BANCO PASTOR, S.A.	ES05137834G5	PAS/PAG 20090929	29/09/2009	C	954,29
BANCO PASTOR, S.A.	ES05137834N1	PAS/PAG 20090407	07/04/2009	C	973,38
BANCO PASTOR, S.A.	ES05137834O9	PAS/PAG 20091009	09/10/2009	C	946,58
BANCO PASTOR, S.A.	ES05137834T8	PAS/PAG 20090427	27/04/2009	C	975,29
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513783532	PAS/PAG 20090213	13/02/2009	C	984,73
BANCO PASTOR, S.A.	ES05137835A5	PAS/PAG 20091104	04/11/2009	C	953,05
BANCO PASTOR, S.A.	ES05137835N8	PAS/PAG 20090602	02/06/2009	C	980,58
BANCO PASTOR, S.A.	ES05137835S7	PAS/PAG 20090615	15/06/2009	C	982,92
BANCO PASTOR, S.A.	ES05137835T5	PAS/PAG 20091207	07/12/2009	C	967,88
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513783631	PAS/PAG 20090304	04/03/2009	C	982,75
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513783748	PAS/PAG 20090401	01/04/2009	C	990,98
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513783763	PAS/PAG 20090316	16/03/2009	C	987,78
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513783821	PAS/PAG 20090327	27/03/2009	C	974,53
BANCO PASTOR, S.A.	ES0513783888	PAS/PAG 20090402	02/04/2009	C	976,30
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804DL6	POP/PAG 20090109	09/01/2009	C	2.975,12
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804HY0	POP/PAG 20090116	16/01/2009	C	2.984,64
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804JU9	POP/PAG 20090206	06/02/2009	C	2.965,24
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804IQ4	POP/PAG 20090220	20/02/2009	C	2.983,47
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804JA6	POP/PAG 20090508	08/05/2009	C	2.928,81
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804JG3	POP/PAG 20090313	13/03/2009	C	2.959,72
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804JN9	POP/PAG 20090320	20/03/2009	C	2.976,16
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804JRO	POP/PAG 20090327	27/03/2009	C	2.942,03
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804JY6	POP/PAG 20090403	03/04/2009	C	2.921,06
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804KG1	POP/PAG 20090417	17/04/2009	C	2.931,72
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804KL1	POP/PAG 20090424	24/04/2009	C	2.927,85
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804LG9	POP/PAG 20090529	29/05/2009	C	2.940,98
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804LI5	POP/PAG 20090306	06/03/2009	C	2.977,44
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804LO3	POP/PAG 20090102	02/01/2009	C	2.971,52
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804LP0	POP/PAG 20090612	12/06/2009	C	2.949,46
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804LQ8	POP/PAG 20091204	04/12/2009	C	2.897,27
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804LT2	POP/PAG 20090619	19/06/2009	C	2.952,88
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804NO9	POP/PAG 20090813	13/08/2009	C	2.907,65
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804ON9	POP/PAG 20090925	25/09/2009	C	2.865,01
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804OY6	POP/PAG 20091009	09/10/2009	C	2.838,94
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804PE5	POP/PAG 20091023	23/10/2009	C	2.882,91
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804PN6	POP/PAG 20090205	05/02/2009	C	2.982,02
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0513804PW7	POP/PAG 20090128	28/01/2009	C	2.993,54
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540189	BBE/PAG 20090212	12/02/2009	C	981,79
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540213	BBE/PAG 20090220	20/02/2009	C	992,56
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540221	BBE/PAG 20090317	17/03/2009	C	991,31
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540247	BBE/PAG 20090325	25/03/2009	C	984,96
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540270	BBE/PAG 20090403	03/04/2009	C	979,94
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540320	BBE/PAG 20090430	30/04/2009	C	973,27
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540338	BBE/PAG 20090505	05/05/2009	C	983,06
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540353	BBE/PAG 20090522	22/05/2009	C	980,38
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540379	BBE/PAG 20090529	29/05/2009	C	973,45
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540395	BBE/PAG 20090609	09/06/2009	C	981,98
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540403	BBE/PAG 20090610	10/06/2009	C	974,66

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540411	BBE/PAG 20090113	13/01/2009	C	997,67
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540445	BBE/PAG 20090703	03/07/2009	C	963,33
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540452	BBE/PAG 20090109	09/01/2009	C	986,30
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540460	BBE/PAG 20090130	30/01/2009	C	989,68
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540486	BBE/PAG 20090206	06/02/2009	C	985,99
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540528	BBE/PAG 20090928	28/09/2009	C	946,70
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540536	BBE/PAG 20090930	30/09/2009	C	946,88
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540544	BBE/PAG 20091002	02/10/2009	C	946,55
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540551	BBE/PAG 20091009	09/10/2009	C	945,65
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540569	BBE/PAG 20091013	13/10/2009	C	962,90
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540577	BBE/PAG 20091029	29/10/2009	C	953,58
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540585	BBE/PAG 20091113	13/11/2009	C	955,91
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540593	BBE/PAG 20090518	18/05/2009	C	978,03
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540601	BBE/PAG 20091124	24/11/2009	C	960,83
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540619	BBE/PAG 20090120	20/01/2009	C	994,23
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540627	BBE/PAG 20090202	02/02/2009	C	993,30
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540635	BBE/PAG 20090603	03/06/2009	C	981,42
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540643	BBE/PAG 20090309	09/03/2009	C	990,79
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540650	BBE/PAG 20090311	11/03/2009	C	991,38
BANESTO BANCO DE EMISIONES, S.A.	ES0513540668	BBE/PAG 20091217	17/12/2009	C	966,38
BANKINTER, S.A.	ES0513679JH7	BKT/PAG 20090120	20/01/2009	C	994,78
BANKINTER, S.A.	ES0513679JR6	BKT/PAG 20090420	20/04/2009	C	974,56
BANKINTER, S.A.	ES0513679JX4	BKT/PAG 20090220	20/02/2009	C	991,66
BANKINTER, S.A.	ES0513679JY2	BKT/PAG 20090520	20/05/2009	C	979,35
BANKINTER, S.A.	ES0513679KE2	BKT/PAG 20090320	20/03/2009	C	985,64
BANKINTER, S.A.	ES0513679KK9	BKT/PAG 20091020	20/10/2009	C	964,66
BANKINTER, S.A.	ES0513679LC4	BKT/PAG 20090202	02/02/2009	C	990,74
BANKINTER, S.A.	ES0513679LK7	BKT/PAG 20090401	01/04/2009	C	974,77
BANKINTER, S.A.	ES0513679LL5	BKT/PAG 20090414	14/04/2009	C	972,91
BANKINTER, S.A.	ES0513679LM3	BKT/PAG 20090720	20/07/2009	C	965,60
BANKINTER, S.A.	ES0513679LO9	BKT/PAG 20090430	30/04/2009	C	975,72
BANKINTER, S.A.	ES0513679LR2	BKT/PAG 20090918	18/09/2009	C	956,08
BANKINTER, S.A.	ES0513679LS0	BKT/PAG 20090529	29/05/2009	C	980,60
BANKINTER, S.A.	ES0513679LT8	BKT/PAG 20090604	04/06/2009	C	969,15
BANKINTER, S.A.	ES0513679LU6	BKT/PAG 20090619	19/06/2009	C	979,07
BANKINTER, S.A.	ES0513679LV4	BKT/PAG 20091120	20/11/2009	C	963,86
BANKINTER, S.A.	ES0513679LX0	BKT/PAG 20100120	20/01/2010	C	960,48
BANKINTER, S.A.	ES0513679LZ5	BKT/PAG 20090112	12/01/2009	C	995,19
BANKINTER, S.A.	ES0513679MA6	BKT/PAG 20090714	14/07/2009	C	966,86
BANKINTER, S.A.	ES0513679MD0	BKT/PAG 20090723	23/07/2009	C	961,80
BANKINTER, S.A.	ES0513679ME8	BKT/PAG 20090730	30/07/2009	C	959,81
BANKINTER, S.A.	ES0513679MF5	BKT/PAG 20090127	27/01/2009	C	992,11
BANKINTER, S.A.	ES0513679MH1	BKT/PAG 20090210	10/02/2009	C	990,08
BANKINTER, S.A.	ES0513679MI9	BKT/PAG 20090810	10/08/2009	C	962,67
BANKINTER, S.A.	ES0513679MJ7	BKT/PAG 20090820	20/08/2009	C	958,46
BANKINTER, S.A.	ES0513679ML3	BKT/PAG 20090316	16/03/2009	C	991,33
BANKINTER, S.A.	ES0513679MO7	BKT/PAG 20090105	05/01/2009	C	993,45
BANKINTER, S.A.	ES0513679MP4	BKT/PAG 20090327	27/03/2009	C	987,85
BANKINTER, S.A.	ES0513679MQ2	BKT/PAG 20091007	07/10/2009	C	947,49
BANKINTER, S.A.	ES0513679MT6	BKT/PAG 20090123	23/01/2009	C	988,16
BANKINTER, S.A.	ES0513679MU4	BKT/PAG 20090504	04/05/2009	C	980,30
BANKINTER, S.A.	ES0513679MX8	BKT/PAG 20090514	14/05/2009	C	978,20
BANKINTER, S.A.	ES0513679MZ3	BKT/PAG 20091029	29/10/2009	C	959,85
BANKINTER, S.A.	ES0513679NA4	BKT/PAG 20090227	27/02/2009	C	993,24
BANKINTER, S.A.	ES0513679NB2	BKT/PAG 20090611	11/06/2009	C	982,06
BANKINTER, S.A.	ES0513679NC0	BKT/PAG 20091218	18/12/2009	C	968,38
BANKINTER, S.A.	ES0513679ND8	BKT/PAG 20091209	09/12/2009	C	966,47
BANKINTER, S.A.	ES0513679NE6	BKT/PAG 20090311	11/03/2009	C	991,44
BANKOA, S.A.	ES0513676T1	BANKOA/PAG 20090306	06/03/2009	C	977,39
BARCLAYS BANK, S.A.	ES05139858A5	BARCLAYS/PAG 20090202	02/02/2009	C	996,00
BARCLAYS BANK, S.A.	ES05139858B3	BARCLAYS/PAG 20090302	02/03/2009	C	993,15
BARCLAYS BANK, S.A.	ES05139858C1	BARCLAYS/PAG 20090401	01/04/2009	C	990,64
BARCLAYS BANK, S.A.	ES05139859A3	BARCLAYS/PAG 20090701	01/07/2009	C	980,51
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134240B9	BBK.EMPTOS/PAG 20091119	19/11/2009	C	958,02
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134240C7	BBK.EMPTOS/PAG 20090415	15/04/2009	C	984,61
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134240E3	BBK.EMPTOS/PAG 20090529	29/05/2009	C	980,37
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134240J2	BBK.EMPTOS/PAG 20090609	09/06/2009	C	982,77
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134240K8	BBK.EMPTOS/PAG 20090612	12/06/2009	C	982,41
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134240L8	BBK.EMPTOS/PAG 20090102	02/01/2009	C	997,07
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134240S3	BBK.EMPTOS/PAG 20090805	05/08/2009	C	959,94
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134240T1	BBK.EMPTOS/PAG 20090303	03/03/2009	C	986,50
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134240V7	BBK.EMPTOS/PAG 20090910	10/09/2009	C	959,84
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134240Y1	BBK.EMPTOS/PAG 20091002	02/10/2009	C	947,40
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134240Z8	BBK.EMPTOS/PAG 20090407	07/04/2009	C	973,50
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134241A9	BBK.EMPTOS/PAG 20091013	13/10/2009	C	951,77
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134241B7	BBK.EMPTOS/PAG 20090427	27/04/2009	C	975,41
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134241C5	BBK.EMPTOS/PAG 20091026	26/10/2009	C	959,59
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134241D3	BBK.EMPTOS/PAG 20091028	28/10/2009	C	952,71
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134241E1	BBK.EMPTOS/PAG 20090129	29/01/2009	C	989,07
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134241F8	BBK.EMPTOS/PAG 20091104	04/11/2009	C	953,22
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134241H4	BBK.EMPTOS/PAG 20090511	11/05/2009	C	977,71
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134241J0	BBK.EMPTOS/PAG 20090602	02/06/2009	C	980,66
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134241K8	BBK.EMPTOS/PAG 20090611	11/06/2009	C	981,37
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134241L6	BBK.EMPTOS/PAG 20091204	04/12/2009	C	962,34
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134241M4	BBK.EMPTOS/PAG 20090112	12/01/2009	C	997,23

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134241N2	BBK.EMPTOS/PAG 20090316	16/03/2009	C	991,58
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134241O0	BBK.EMPTOS/PAG 20090615	15/06/2009	C	983,59
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134241P7	BBK.EMPTOS/PAG 20091210	10/12/2009	C	967,48
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES05134241Q5	BBK.EMPTOS/PAG 20090130	30/01/2009	C	997,12
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424756	BBK.EMPTOS/PAG 20090220	20/02/2009	C	992,59
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424798	BBK.EMPTOS/PAG 20090109	09/01/2009	C	991,82
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424806	BBK.EMPTOS/PAG 20090520	20/05/2009	C	973,56
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424822	BBK.EMPTOS/PAG 20090114	14/01/2009	C	996,26
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424863	BBK.EMPTOS/PAG 20090210	10/02/2009	C	992,96
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424905	BBK.EMPTOS/PAG 20090327	27/03/2009	C	986,04
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424947	BBK.EMPTOS/PAG 20090408	08/04/2009	C	973,15
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424988	BBK.EMPTOS/PAG 20090430	30/04/2009	C	977,06
BBK EMPRESTITOS, S.A.U.	ES0513424996	BBK.EMPTOS/PAG 20090505	05/05/2009	C	978,04
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AA4	BBVAF/PAG 20090326	26/03/2009	C	985,24
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AB2	BBVAF/PAG 20090331	31/03/2009	C	982,31
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AC0	BBVAF/PAG 20090324	24/03/2009	C	991,23
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AE6	BBVAF/PAG 20090403	03/04/2009	C	979,38
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AH9	BBVAF/PAG 20090930	30/09/2009	C	958,09
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AI7	BBVAF/PAG 20091012	12/10/2009	C	948,13
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AJ5	BBVAF/PAG 20090116	16/01/2009	C	992,67
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AL1	BBVAF/PAG 20090119	19/01/2009	C	992,66
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AM9	BBVAF/PAG 20090303	03/03/2009	C	981,22
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AN7	BBVAF/PAG 20091014	14/10/2009	C	950,20
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AO5	BBVAF/PAG 20091016	16/10/2009	C	963,24
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AP2	BBVAF/PAG 20090420	20/04/2009	C	975,28
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AQ0	BBVAF/PAG 20090422	22/04/2009	C	976,15
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AR8	BBVAF/PAG 20090121	21/01/2009	C	995,43
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AT4	BBVAF/PAG 20090427	27/04/2009	C	976,71
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AU2	BBVAF/PAG 20090128	28/01/2009	C	992,46
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AW8	BBVAF/PAG 20091027	27/10/2009	C	952,51
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AX6	BBVAF/PAG 20091028	28/10/2009	C	952,61
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AY4	BBVAF/PAG 20090202	02/02/2009	C	994,02
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687AZ1	BBVAF/PAG 20090204	04/02/2009	C	993,70
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BA2	BBVAF/PAG 20090220	20/02/2009	C	989,91
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BB0	BBVAF/PAG 20090831	31/08/2009	C	962,60
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BC8	BBVAF/PAG 20090210	10/02/2009	C	988,99
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BD6	BBVAF/PAG 20090910	10/09/2009	C	962,71
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BE4	BBVAF/PAG 20090514	14/05/2009	C	978,22
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BF1	BBVAF/PAG 20090625	25/06/2009	C	973,84
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BG9	BBVAF/PAG 20091013	13/10/2009	C	961,21
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BI5	BBVAF/PAG 20090518	18/05/2009	C	979,55
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BJ3	BBVAF/PAG 20090519	19/05/2009	C	979,35
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BK1	BBVAF/PAG 20091029	29/10/2009	C	962,24
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BL9	BBVAF/PAG 20090217	17/02/2009	C	995,29
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BM7	BBVAF/PAG 20090520	20/05/2009	C	979,49
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BN5	BBVAF/PAG 20091118	18/11/2009	C	959,06
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BO3	BBVAF/PAG 20090618	18/06/2009	C	976,50
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BP0	BBVAF/PAG 20091119	19/11/2009	C	960,16
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BS4	BBVAF/PAG 20091123	23/11/2009	C	960,47
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BT2	BBVAF/PAG 20090224	24/02/2009	C	990,35
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BU0	BBVAF/PAG 20090226	26/02/2009	C	990,53
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BV8	BBVAF/PAG 20091201	01/12/2009	C	964,04
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BW6	BBVAF/PAG 20090415	15/04/2009	C	989,64
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BX4	BBVAF/PAG 20090304	04/03/2009	C	991,80
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BY2	BBVAF/PAG 20090311	11/03/2009	C	991,86
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687BZ9	BBVAF/PAG 20090212	12/02/2009	C	994,50
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687CB8	BBVAF/PAG 20090218	18/02/2009	C	994,25
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687CC6	BBVAF/PAG 20090319	19/03/2009	C	992,41
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687F64	BBVAF/PAG 20090216	16/02/2009	C	994,09
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687G30	BBVAF/PAG 20090112	12/01/2009	C	993,72
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687G48	BBVAF/PAG 20090309	09/03/2009	C	987,72
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687H88	BBVAF/PAG 20090401	01/04/2009	C	974,49
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687I61	BBVAF/PAG 20090409	09/04/2009	C	975,04
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687J29	BBVAF/PAG 20090414	14/04/2009	C	977,41
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687J52	BBVAF/PAG 20090416	16/04/2009	C	988,80
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687J78	BBVAF/PAG 20090417	17/04/2009	C	975,16
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687K18	BBVAF/PAG 20090421	21/04/2009	C	975,18
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687K42	BBVAF/PAG 20090126	26/01/2009	C	993,68
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687K59	BBVAF/PAG 20090423	23/04/2009	C	976,64
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687K67	BBVAF/PAG 20090424	24/04/2009	C	975,70
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687L09	BBVAF/PAG 20090429	29/04/2009	C	983,82
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687L58	BBVAF/PAG 20090504	04/05/2009	C	976,44
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687L82	BBVAF/PAG 20090505	05/05/2009	C	977,82
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687M24	BBVAF/PAG 20090507	07/05/2009	C	977,32
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687M40	BBVAF/PAG 20090109	09/01/2009	C	989,03
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687M73	BBVAF/PAG 20090511	11/05/2009	C	978,42
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687N31	BBVAF/PAG 20090515	15/05/2009	C	979,19
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687N72	BBVAF/PAG 20090223	23/02/2009	C	992,97
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687N80	BBVAF/PAG 20090521	21/05/2009	C	979,43
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687O06	BBVAF/PAG 20090123	23/01/2009	C	993,28
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687O14	BBVAF/PAG 20090522	22/05/2009	C	979,27
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687O55	BBVAF/PAG 20090525	25/05/2009	C	981,28
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687P13	BBVAF/PAG 20090327	27/03/2009	C	987,65
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687P21	BBVAF/PAG 20090529	29/05/2009	C	981,10
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687P88	BBVAF/PAG 20090602	02/06/2009	C	985,05

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687Q04	BBVAF/PAG 20090603	03/06/2009	C	981,58
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687Q20	BBVAF/PAG 20090305	05/03/2009	C	990,87
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687Q87	BBVAF/PAG 20090609	09/06/2009	C	981,89
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687Q95	BBVAF/PAG 20090610	10/06/2009	C	985,43
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687R03	BBVAF/PAG 20090611	11/06/2009	C	983,36
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687R29	BBVAF/PAG 20090313	13/03/2009	C	991,49
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687R37	BBVAF/PAG 20090612	12/06/2009	C	983,76
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687R52	BBVAF/PAG 20090120	20/01/2009	C	991,79
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687R60	BBVAF/PAG 20090615	15/06/2009	C	980,42
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687S44	BBVAF/PAG 20090617	17/06/2009	C	974,88
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687S69	BBVAF/PAG 20090506	06/05/2009	C	976,68
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687T01	BBVAF/PAG 20090408	08/04/2009	C	973,35
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687T27	BBVAF/PAG 20090102	02/01/2009	C	988,83
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687T43	BBVAF/PAG 20090430	30/04/2009	C	976,37
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687T50	BBVAF/PAG 20090629	29/06/2009	C	966,13
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687T68	BBVAF/PAG 20090330	30/03/2009	C	980,00
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687T76	BBVAF/PAG 20090701	01/07/2009	C	966,61
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687T92	BBVAF/PAG 20090105	05/01/2009	C	991,35
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687U16	BBVAF/PAG 20090108	08/01/2009	C	992,93
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687U24	BBVAF/PAG 20090209	09/02/2009	C	992,88
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687U32	BBVAF/PAG 20090622	22/06/2009	C	983,68
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687U57	BBVAF/PAG 20090107	07/01/2009	C	994,86
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687U73	BBVAF/PAG 20090115	15/01/2009	C	993,42
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687V23	BBVAF/PAG 20090713	13/07/2009	C	971,90
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687V31	BBVAF/PAG 20090114	14/01/2009	C	990,57
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687V56	BBVAF/PAG 20090716	16/07/2009	C	971,07
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687V64	BBVAF/PAG 20090717	17/07/2009	C	973,24
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687V98	BBVAF/PAG 20090122	22/01/2009	C	995,42
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687W22	BBVAF/PAG 20090129	29/01/2009	C	996,44
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687W48	BBVAF/PAG 20090225	25/02/2009	C	988,83
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687W63	BBVAF/PAG 20090227	27/02/2009	C	982,32
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687X05	BBVAF/PAG 20090127	27/01/2009	C	988,29
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687X21	BBVAF/PAG 20090729	29/07/2009	C	962,26
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687X39	BBVAF/PAG 20090130	30/01/2009	C	992,97
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687X88	BBVAF/PAG 20090205	05/02/2009	C	988,05
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687X96	BBVAF/PAG 20090213	13/02/2009	C	991,52
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687Y12	BBVAF/PAG 20090219	19/02/2009	C	989,69
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687Y38	BBVAF/PAG 20090302	02/03/2009	C	991,72
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687Y79	BBVAF/PAG 20090310	10/03/2009	C	979,80
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687Y87	BBVAF/PAG 20090206	06/02/2009	C	988,33
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687Y95	BBVAF/PAG 20090312	12/03/2009	C	991,81
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687Z11	BBVAF/PAG 20090316	16/03/2009	C	991,91
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687Z29	BBVAF/PAG 20090113	13/01/2009	C	992,05
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687Z37	BBVAF/PAG 20090318	18/03/2009	C	991,37
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687Z52	BBVAF/PAG 20090619	19/06/2009	C	984,83
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687Z60	BBVAF/PAG 20090317	17/03/2009	C	992,44
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687Z78	BBVAF/PAG 20090323	23/03/2009	C	992,43
BBVA BANCO DE FINANCIACION, S.A.	ES0513687Z86	BBVAF/PAG 20090203	03/02/2009	C	982,24
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES05149585U0	CAIXANOVA/PAG 20090206	06/02/2009	C	994,66
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES05149585X4	CAIXANOVA/PAG 20090227	27/02/2009	C	992,72
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES05149586L7	CAIXANOVA/PAG 20090424	24/04/2009	C	974,84
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES05149586W4	CAIXANOVA/PAG 20090525	25/05/2009	C	973,98
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES05149587M3	CAIXANOVA/PAG 20090108	08/01/2009	C	995,83
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES05149587M3	CAIXANOVA/PAG 20090122	22/01/2009	C	995,08
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES05149587P6	CAIXANOVA/PAG 20090129	29/01/2009	C	996,68
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES05149587T8	CAIXANOVA/PAG 20090310	10/03/2009	C	993,26
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES05149588E8	CAIXANOVA/PAG 20090911	11/09/2009	C	965,81
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES05149588G3	CAIXANOVA/PAG 20090120	20/01/2009	C	996,99
CAIXA DE AFORROS DE VIGO, OURENSE E PONTEVEDRA (CAIXA	ES05149588I9	CAIXANOVA/PAG 20090213	13/02/2009	C	994,54
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840A11	CA.CATALUNYA/PAG 20090121	21/01/2009	C	49.627,49
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840BK5	CA.CATALUNYA/PAG 20090128	28/01/2009	C	49.458,96
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840BL3	CA.CATALUNYA/PAG 20090204	04/02/2009	C	49.746,06
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840BS8	CA.CATALUNYA/PAG 20090219	19/02/2009	C	49.264,85
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840BV2	CA.CATALUNYA/PAG 20090212	12/02/2009	C	49.193,62
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840CJ5	CA.CATALUNYA/PAG 20090312	12/03/2009	C	49.198,54
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840CP2	CA.CATALUNYA/PAG 20090416	16/04/2009	C	48.876,10
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840CU2	CA.CATALUNYA/PAG 20090226	26/02/2009	C	49.476,78
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840DC8	CA.CATALUNYA/PAG 20090423	23/04/2009	C	48.920,30
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840DE4	CA.CATALUNYA/PAG 20090430	30/04/2009	C	48.693,08
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840DJ3	CA.CATALUNYA/PAG 20090507	07/05/2009	C	48.815,65
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840DN5	CA.CATALUNYA/PAG 20090521	21/05/2009	C	48.921,31
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840DO3	CA.CATALUNYA/PAG 20090528	28/05/2009	C	48.862,88
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840DR6	CA.CATALUNYA/PAG 20090611	11/06/2009	C	48.576,30
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840DT2	CA.CATALUNYA/PAG 20090618	18/06/2009	C	48.458,96
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840DW6	CA.CATALUNYA/PAG 20090108	08/01/2009	C	49.868,84
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840DZ9	CA.CATALUNYA/PAG 20090115	15/01/2009	C	49.792,55
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840EE2	CA.CATALUNYA/PAG 20090806	06/08/2009	C	48.137,79
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840EL3	CA.CATALUNYA/PAG 20091008	08/10/2009	C	47.875,15
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840EN7	CA.CATALUNYA/PAG 20091112	12/11/2009	C	47.762,33
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840EO1	CA.CATALUNYA/PAG 20091126	26/11/2009	C	47.974,62
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840EP8	CA.CATALUNYA/PAG 20091210	10/12/2009	C	48.382,83
CAIXA D'ESTALVIS DE CATALUNYA	ES0514840EQ6	CA.CATALUNYA/PAG 20091203	03/12/2009	C	48.318,06
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES05132490H9	CA.GIRONA/PAG 20090729	29/07/2009	C	967,14
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES05132490K3	CA.GIRONA/PAG 20090826	26/08/2009	C	978,90
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES05132490P2	CA.GIRONA/PAG 20090318	18/03/2009	C	985,72

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES05132490Y4	CA.GIRONA/PAG 20090204	04/02/2009	C	987,98
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249914	CA.GIRONA/PAG 20090325	25/03/2009	C	984,07
CAIXA D'ESTALVIS DE GIRONA	ES0513249989	CA.GIRONA/PAG 20090520	20/05/2009	C	973,68
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES05148500B0	CA.MANRESA/PAG 20090107	07/01/2009	C	989,77
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES05148500D6	CA.MANRESA/PAG 20090414	14/04/2009	C	972,86
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES05148500G9	CA.MANRESA/PAG 20091110	10/11/2009	C	955,66
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850660	CA.MANRESA/PAG 20090205	05/02/2009	C	987,88
CAIXA D'ESTALVIS DE MANRESA	ES0514850843	CA.MANRESA/PAG 20090527	27/05/2009	C	971,36
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0514973223	CA.SABADELL/PAG 20090116	16/01/2009	C	991,17
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0514973306	CA.SABADELL/PAG 20090316	16/03/2009	C	992,60
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0514973322	CA.SABADELL/PAG 20090511	11/05/2009	C	971,38
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0514973397	CA.SABADELL/PAG 20090130	30/01/2009	C	991,69
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0514973421	CA.SABADELL/PAG 20090123	23/01/2009	C	997,10
CAIXA D'ESTALVIS DE SABADELL	ES0514973439	CA.SABADELL/PAG 20090206	06/02/2009	C	995,82
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES05153460A1	CA.TARRAGONA/PAG 20090327	27/03/2009	C	974,31
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES05153460C7	CA.TARRAGONA/PAG 20090528	28/05/2009	C	981,49
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346817	CA.TARRAGONA/PAG 20090113	13/01/2009	C	990,61
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346858	CA.TARRAGONA/PAG 20090213	13/02/2009	C	991,92
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346882	CA.TARRAGONA/PAG 20090407	07/04/2009	C	973,12
CAIXA D'ESTALVIS DE TARRAGONA	ES0515346965	CA.TARRAGONA/PAG 20090623	23/06/2009	C	988,21
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149661K0	CA.PENEDES/PAG 20090114	14/01/2009	C	993,42
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149662C5	CA.PENEDES/PAG 20090416	16/04/2009	C	971,82
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149662J0	CA.PENEDES/PAG 20090506	06/05/2009	C	975,66
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149662O0	CA.PENEDES/PAG 20090603	03/06/2009	C	980,83
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149662P7	CA.PENEDES/PAG 20090610	10/06/2009	C	971,82
CAIXA D'ESTALVIS DEL PENEDES	ES05149662V5	CA.PENEDES/PAG 20090708	08/07/2009	C	966,94
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846361	CA.LAIETANA/PAG 20090409	09/04/2009	C	979,27
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846494	CA.LAIETANA/PAG 20090611	11/06/2009	C	971,25
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846510	CA.LAIETANA/PAG 20091203	03/12/2009	C	965,90
CAIXA D'ESTALVIS LAIETANA	ES0514846528	CA.LAIETANA/PAG 20091210	10/12/2009	C	967,66
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0514826016	CAJASTUR/PAG 20090206	06/02/2009	C	49,067,03
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES0514826020	CAJASTUR/PAG 20090529	29/05/2009	C	49,173,21
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES05148261A1	CAJASTUR/PAG 20090612	12/06/2009	C	49,114,92
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES05148261F0	CAJASTUR/PAG 20090911	11/09/2009	C	47,656,59
CAJA DE AHORROS DE ASTURIAS	ES05148261S3	CAJASTUR/PAG 20090220	20/02/2009	C	49,732,61
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154241E6	CCM/PAG 20090102	02/01/2009	C	98,803,15
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154241I7	CCM/PAG 20090210	10/02/2009	C	98,534,24
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154241L1	CCM/PAG 20090311	11/03/2009	C	98,422,14
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154241U2	CCM/PAG 20090624	24/06/2009	C	96,833,37
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154241Y4	CCM/PAG 20090929	29/09/2009	C	94,927,15
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154242A2	CCM/PAG 20090722	22/07/2009	C	96,555,13
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154242B0	CCM/PAG 20091023	23/10/2009	C	95,943,77
CAJA DE AHORROS DE CASTILLA-LA MANCHA	ES05154242C8	CCM/PAG 20091105	05/11/2009	C	95,622,77
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148431Z7	CAIXAGALICIA/PAG 20090617	17/06/2009	C	968,86
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432J9	CAIXAGALICIA/PAG 20090916	16/09/2009	C	952,27
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432N1	CAIXAGALICIA/PAG 20091026	26/10/2009	C	969,99
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432P6	CAIXAGALICIA/PAG 20091022	22/10/2009	C	984,70
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432U6	CAIXAGALICIA/PAG 20091016	06/10/2009	C	992,26
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432V4	CAIXAGALICIA/PAG 20091030	30/10/2009	C	990,69
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432Y8	CAIXAGALICIA/PAG 20090227	27/02/2009	C	990,07
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148432Z5	CAIXAGALICIA/PAG 20090318	18/03/2009	C	991,64
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148433A6	CAIXAGALICIA/PAG 20090327	27/03/2009	C	974,33
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148433G3	CAIXAGALICIA/PAG 20090506	06/05/2009	C	974,98
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148433I9	CAIXAGALICIA/PAG 20090603	03/06/2009	C	985,35
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148433Q2	CAIXAGALICIA/PAG 20090729	29/07/2009	C	962,76
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148433S8	CAIXAGALICIA/PAG 20090304	04/03/2009	C	983,13
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148433T6	CAIXAGALICIA/PAG 20090828	28/08/2009	C	958,35
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148433U4	CAIXAGALICIA/PAG 20090819	19/08/2009	C	962,23
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148433V2	CAIXAGALICIA/PAG 20091104	04/11/2009	C	961,52
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148433W0	CAIXAGALICIA/PAG 20091111	11/11/2009	C	956,12
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148433X8	CAIXAGALICIA/PAG 20091118	18/11/2009	C	960,95
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148433Y6	CAIXAGALICIA/PAG 20090727	27/07/2009	C	972,74
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148433Z3	CAIXAGALICIA/PAG 20091202	02/12/2009	C	966,85
CAJA DE AHORROS DE GALICIA	ES05148434A4	CAIXAGALICIA/PAG 20091209	09/12/2009	C	967,28
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148451H3	CAI/PAG 20090408	08/04/2009	C	98,093,87
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148451S0	CAI/PAG 20090312	12/03/2009	C	98,324,60
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148451T8	CAI/PAG 20090616	16/06/2009	C	98,084,33
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148451V4	CAI/PAG 20090612	12/06/2009	C	97,102,09
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148452M1	CAI/PAG 20090302	02/03/2009	C	99,014,98
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148452N9	CAI/PAG 20090304	04/03/2009	C	99,228,30
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148452O7	CAI/PAG 20090911	11/09/2009	C	96,998,06
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148452T6	CAI/PAG 20090123	23/01/2009	C	98,993,70
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148452V2	CAI/PAG 20091204	04/12/2009	C	96,181,59
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148452W0	CAI/PAG 20090227	27/02/2009	C	99,117,91
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148452X8	CAI/PAG 20090306	06/03/2009	C	99,127,43
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148452Z3	CAI/PAG 20090311	11/03/2009	C	99,140,98
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148453A4	CAI/PAG 20090323	23/03/2009	C	99,173,85
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148453B2	CAI/PAG 20090319	19/03/2009	C	99,227,80
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148453C0	CAI/PAG 20090624	24/06/2009	C	98,443,21
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148453D8	CAI/PAG 20090318	18/03/2009	C	99,322,84
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148453E6	CAI/PAG 20090320	20/03/2009	C	99,304,50
CAJA DE AHORROS DE LA INMACULADA DE ARAGON	ES05148453F3	CAI/PAG 20090327	27/03/2009	C	99,247,46
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155301C1	CA.RIOJA/PAG 20090109	09/01/2009	C	98,555,16
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155301G2	CA.RIOJA/PAG 20090129	29/01/2009	C	98,716,76
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155301M0	CA.RIOJA/PAG 20090310	10/03/2009	C	98,936,65

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155301S7	CA.RIOJA/PAG 20090407	07/04/2009	C	98.835,58
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155302J4	CA.RIOJA/PAG 20090116	16/01/2009	C	98.503,70
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155302N6	CA.RIOJA/PAG 20091009	09/10/2009	C	95.840,30
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155302T3	CA.RIOJA/PAG 20091112	12/11/2009	C	95.987,19
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155302U1	CA.RIOJA/PAG 20090529	29/05/2009	C	98.195,39
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155302X5	CA.RIOJA/PAG 20090615	15/06/2009	C	98.280,39
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155302Y3	CA.RIOJA/PAG 20091207	07/12/2009	C	96.719,77
CAJA DE AHORROS DE LA RIOJA	ES05155303A1	CA.RIOJA/PAG 20090102	02/01/2009	C	99.939,03
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146003U7	CA.MURCIA/PAG 20090217	17/02/2009	C	984,72
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146004B5	CA.MURCIA/PAG 20091026	26/10/2009	C	970,74
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146004C3	CA.MURCIA/PAG 20090529	29/05/2009	C	976,86
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146004D1	CA.MURCIA/PAG 20090604	04/06/2009	C	972,82
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146004J8	CA.MURCIA/PAG 20090202	02/02/2009	C	991,62
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146004K6	CA.MURCIA/PAG 20090731	31/07/2009	C	964,38
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146004M2	CA.MURCIA/PAG 20090828	28/08/2009	C	966,09
CAJA DE AHORROS DE MURCIA	ES05146004S9	CA.MURCIA/PAG 20090123	23/01/2009	C	989,80
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES05148549Z6	CAJADUERO/PAG 20090114	14/01/2009	C	990,95
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854A23	CAJADUERO/PAG 20090219	19/02/2009	C	988,62
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854A31	CAJADUERO/PAG 20090312	12/03/2009	C	985,00
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854A64	CAJADUERO/PAG 20090403	03/04/2009	C	985,04
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854B14	CAJADUERO/PAG 20090508	08/05/2009	C	979,05
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854B30	CAJADUERO/PAG 20090529	29/05/2009	C	974,83
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854B63	CAJADUERO/PAG 20091016	16/10/2009	C	952,55
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854B89	CAJADUERO/PAG 20090728	28/07/2009	C	956,32
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854B97	CAJADUERO/PAG 20090130	30/01/2009	C	987,85
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854C13	CAJADUERO/PAG 20090204	04/02/2009	C	989,59
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854C54	CAJADUERO/PAG 20090105	05/01/2009	C	987,45
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854C62	CAJADUERO/PAG 20090902	02/09/2009	C	950,26
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854C70	CAJADUERO/PAG 20090316	16/03/2009	C	982,71
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854D01	CAJADUERO/PAG 20090611	11/06/2009	C	984,31
CAJA DE AHORROS DE SALAMANCA Y SORIA	ES0514854D95	CAJADUERO/PAG 20090623	23/06/2009	C	984,01
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149754P2	CA.CANTABRIA/PAG 20090402	02/04/2009	C	9.751,29
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149755J2	CA.CANTABRIA/PAG 20090520	20/05/2009	C	9.771,85
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149755M6	CA.CANTABRIA/PAG 20090610	10/06/2009	C	9.834,70
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149755P9	CA.CANTABRIA/PAG 20090624	24/06/2009	C	9.679,39
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149755R5	CA.CANTABRIA/PAG 20090714	14/07/2009	C	9.657,44
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149755S3	CA.CANTABRIA/PAG 20090115	15/01/2009	C	9.846,42
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149756C5	CA.CANTABRIA/PAG 20090324	24/03/2009	C	9.747,81
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149756F8	CA.CANTABRIA/PAG 20091006	06/10/2009	C	9.526,21
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149756G6	CA.CANTABRIA/PAG 20090427	27/04/2009	C	9.752,67
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149756I2	CA.CANTABRIA/PAG 20090529	29/05/2009	C	9.805,63
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149756J0	CA.CANTABRIA/PAG 20100120	20/01/2010	C	9.569,21
CAJA DE AHORROS DE SANTANDER Y CANTABRIA	ES05149756L6	CA.CANTABRIA/PAG 20091204	04/12/2009	C	9.622,30
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0514977B08	BANCAJA/PAG 20090107	07/01/2009	C	987,75
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0514977B16	BANCAJA/PAG 20090109	09/01/2009	C	989,95
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0514977B40	BANCAJA/PAG 20090112	12/01/2009	C	997,00
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0514977B81	BANCAJA/PAG 20090129	29/01/2009	C	994,13
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0514977C07	BANCAJA/PAG 20090210	10/02/2009	C	989,30
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0514977C64	BANCAJA/PAG 20090401	01/04/2009	C	973,55
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0514977D55	BANCAJA/PAG 20090529	29/05/2009	C	980,96
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0514977F12	BANCAJA/PAG 20090825	25/08/2009	C	955,27
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0514977F53	BANCAJA/PAG 20090330	30/03/2009	C	973,96
CAJA DE AHORROS DE VALENCIA, CASTELLON Y ALICANTE, BAN	ES0514977G37	BANCAJA/PAG 20090225	25/02/2009	C	993,45
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153080D1	CA.VITAL/PAG 20090122	22/01/2009	C	98.596,28
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153080K6	CA.VITAL/PAG 20090219	19/02/2009	C	99.013,18
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153080L4	CA.VITAL/PAG 20090423	23/04/2009	C	97.268,14
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153080S9	CA.VITAL/PAG 20090504	04/05/2009	C	97.767,81
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153080Y7	CA.VITAL/PAG 20090115	15/01/2009	C	98.680,80
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153081C1	CA.VITAL/PAG 20090205	05/02/2009	C	99.434,34
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153081F4	CA.VITAL/PAG 20091002	02/10/2009	C	94.759,78
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153081S7	CA.VITAL/PAG 20091207	07/12/2009	C	96.599,30
CAJA DE AHORROS DE VITORIA Y ALAVA	ES05153081T5	CA.VITAL/PAG 20091211	11/12/2009	C	96.766,16
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144007L9	CAM/PAG 20090108	08/01/2009	C	987,98
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144007R6	CAM/PAG 20090226	26/02/2009	C	990,45
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144007Y2	CAM/PAG 20090430	30/04/2009	C	976,11
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144008H5	CAM/PAG 20090611	11/06/2009	C	973,29
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144008J1	CAM/PAG 20090625	25/06/2009	C	971,45
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES05144008Z7	CAM/PAG 20090319	19/03/2009	C	991,61
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149614B8	CA.BURGOS/PAG 20090115	15/01/2009	C	9.895,01
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149614I3	CA.BURGOS/PAG 20090102	02/01/2009	C	9.915,80
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149614L7	CA.BURGOS/PAG 20090216	16/02/2009	C	9.906,78
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149614N3	CA.BURGOS/PAG 20090302	02/03/2009	C	9.812,51
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149614O1	CA.BURGOS/PAG 20090317	17/03/2009	C	9.823,39
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149614Q6	CA.BURGOS/PAG 20090401	01/04/2009	C	9.796,48
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149614S2	CA.BURGOS/PAG 20090504	04/05/2009	C	9.739,11
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149614V6	CA.BURGOS/PAG 20090615	15/06/2009	C	9.693,85
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149615B5	CA.BURGOS/PAG 20090313	13/03/2009	C	9.801,45
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149615E9	CA.BURGOS/PAG 20091013	13/10/2009	C	9.572,24
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149615G4	CA.BURGOS/PAG 20091102	02/11/2009	C	9.530,94
CAJA DE AHORROS MUNICIPAL DE BURGOS	ES05149615J8	CA.BURGOS/PAG 20091201	01/12/2009	C	9.670,42
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910159	CA.AVILA/PAG 20090109	09/01/2009	C	98.652,23
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910167	CA.AVILA/PAG 20090114	14/01/2009	C	99.714,22
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910415	CA.AVILA/PAG 20090220	20/02/2009	C	98.458,54
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910456	CA.AVILA/PAG 20090909	09/09/2009	C	95.868,31
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910522	CA.AVILA/PAG 20090925	25/09/2009	C	95.710,22

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910548	CA.AVILA/PAG 20090316	16/03/2009	C	98.504,97
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910555	CA.AVILA/PAG 20090610	10/06/2009	C	97.234,98
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910613	CA.AVILA/PAG 20090123	23/01/2009	C	99.610,99
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910621	CA.AVILA/PAG 20091207	07/12/2009	C	96.647,24
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE AVILA	ES0514910639	CA.AVILA/PAG 20090102	02/01/2009	C	99.930,92
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES05149260H7	SA.NOSTRA/PAG 20090327	27/03/2009	C	9.794,77
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES05149260T2	SA.NOSTRA/PAG 20090430	30/04/2009	C	9.762,62
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES05149260V8	SA.NOSTRA/PAG 20090514	14/05/2009	C	9.769,93
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES05149261D4	SA.NOSTRA/PAG 20090703	03/07/2009	C	9.651,28
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES05149261Q6	SA.NOSTRA/PAG 20090306	06/03/2009	C	9.861,15
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES05149261T0	SA.NOSTRA/PAG 20090309	09/03/2009	C	9.823,38
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES05149262E0	SA.NOSTRA/PAG 20090612	12/06/2009	C	9.745,84
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES05149262J9	SA.NOSTRA/PAG 20091116	16/11/2009	C	9.649,01
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES05149262M3	SA.NOSTRA/PAG 20090302	02/03/2009	C	9.909,79
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE BALEARES	ES05149262P6	SA.NOSTRA/PAG 20090317	17/03/2009	C	9.925,02
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES05647300C9	CAJASUR/PAG 20090120	20/01/2009	C	99.268,47
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES05647300G0	CAJASUR/PAG 20090528	28/05/2009	C	9.712,22
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES05647300I6	CAJASUR/PAG 20090610	10/06/2009	C	9.723,09
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES05647300M8	CAJASUR/PAG 20090130	30/01/2009	C	9.900,28
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES05647300V9	CAJASUR/PAG 20091118	18/11/2009	C	9.575,58
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES05647300W7	CAJASUR/PAG 20090202	02/02/2009	C	9.927,47
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE CORDOBA	ES05647300X5	CAJASUR/PAG 20090302	02/03/2009	C	9.904,07
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE EXTREMADURA	ES0514987025	CA.EXTREM/PAG 20090130	30/01/2009	C	24.682,05
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES05149509I5	CA.MADRID/PAG 20090102	02/01/2009	C	992,49
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES05149509J3	CA.MADRID/PAG 20090105	05/01/2009	C	990,88
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES05149509R6	CA.MADRID/PAG 20090120	20/01/2009	C	989,26
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950A34	CA.MADRID/PAG 20090206	06/02/2009	C	991,19
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950B09	CA.MADRID/PAG 20090220	20/02/2009	C	983,79
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950C81	CA.MADRID/PAG 20090330	30/03/2009	C	974,12
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950E97	CA.MADRID/PAG 20090428	28/04/2009	C	977,86
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950F05	CA.MADRID/PAG 20090507	07/05/2009	C	973,34
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950G61	CA.MADRID/PAG 20090529	29/05/2009	C	980,66
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950H45	CA.MADRID/PAG 20090624	24/06/2009	C	973,58
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950J27	CA.MADRID/PAG 20090130	30/01/2009	C	982,79
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950M14	CA.MADRID/PAG 20090324	24/03/2009	C	991,87
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950M89	CA.MADRID/PAG 20090925	25/09/2009	C	954,87
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950N47	CA.MADRID/PAG 20091006	06/10/2009	C	956,44
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950N54	CA.MADRID/PAG 20090407	07/04/2009	C	973,38
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950N88	CA.MADRID/PAG 20091009	09/10/2009	C	946,84
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950O77	CA.MADRID/PAG 20090119	19/01/2009	C	987,22
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950P37	CA.MADRID/PAG 20090427	27/04/2009	C	975,34
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950P78	CA.MADRID/PAG 20090209	09/02/2009	C	987,94
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950P86	CA.MADRID/PAG 20090514	14/05/2009	C	978,17
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950Q10	CA.MADRID/PAG 20090518	18/05/2009	C	978,19
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950Q44	CA.MADRID/PAG 20090525	25/05/2009	C	978,53
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950Q69	CA.MADRID/PAG 20090227	27/02/2009	C	995,48
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950Q93	CA.MADRID/PAG 20090602	02/06/2009	C	979,58
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950R01	CA.MADRID/PAG 20090115	15/01/2009	C	995,65
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950R19	CA.MADRID/PAG 20090203	03/02/2009	C	993,72
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950R50	CA.MADRID/PAG 20090609	09/06/2009	C	983,30
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950R68	CA.MADRID/PAG 20090605	05/06/2009	C	982,23
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950R76	CA.MADRID/PAG 20090721	21/07/2009	C	977,55
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950S00	CA.MADRID/PAG 20091210	10/12/2009	C	962,84
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950S34	CA.MADRID/PAG 20090612	12/06/2009	C	982,61
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE MADRID	ES0514950T09	CA.MADRID/PAG 20091221	21/12/2009	C	967,52
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657T9	CAN/PAG 20090113	13/01/2009	C	98.798,99
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657W3	CAN/PAG 20090120	20/01/2009	C	99.410,03
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149657Z6	CAN/PAG 20090203	03/02/2009	C	98.794,80
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149658A7	CAN/PAG 20090210	10/02/2009	C	99.458,58
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149658D1	CAN/PAG 20090224	24/02/2009	C	99.029,10
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149658E9	CAN/PAG 20090303	03/03/2009	C	98.939,58
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149658G4	CAN/PAG 20090324	24/03/2009	C	97.480,40
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149658J8	CAN/PAG 20090407	07/04/2009	C	97.331,39
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149658R1	CAN/PAG 20090512	12/05/2009	C	96.941,51
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149658S9	CAN/PAG 20090526	26/05/2009	C	97.907,84
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149658U5	CAN/PAG 20090602	02/06/2009	C	98.036,34
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149658V3	CAN/PAG 20090616	16/06/2009	C	98.251,49
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149658W1	CAN/PAG 20090609	09/06/2009	C	98.086,30
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149659B3	CAN/PAG 20090825	25/08/2009	C	96.700,56
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149659H0	CAN/PAG 20091103	03/11/2009	C	95.414,61
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149659J8	CAN/PAG 20091110	10/11/2009	C	95.945,15
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149659J6	CAN/PAG 20090721	21/07/2009	C	97.153,31
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149659K4	CAN/PAG 20091117	17/11/2009	C	95.664,41
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149659M0	CAN/PAG 20091124	24/11/2009	C	96.801,27
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE NAVARRA	ES05149659N8	CAN/PAG 20091201	01/12/2009	C	96.794,45
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0514959024	CA.SEGOVIA/PAG 20090120	20/01/2009	C	49.542,11
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0514959107	CA.SEGOVIA/PAG 20090310	10/03/2009	C	49.668,06
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0514959230	CA.SEGOVIA/PAG 20090617	17/06/2009	C	48.534,57
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0514959271	CA.SEGOVIA/PAG 20091015	15/10/2009	C	48.088,92
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0514959297	CA.SEGOVIA/PAG 20090520	20/05/2009	C	48.665,25
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0514959313	CA.SEGOVIA/PAG 20090904	04/09/2009	C	48.224,81
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES05149540A7	IBERCAJA/PAG 20091022	22/10/2009	C	965,31
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES05149540B5	IBERCAJA/PAG 20090423	23/04/2009	C	975,83
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES05149540C3	IBERCAJA/PAG 20090226	26/02/2009	C	990,47
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES05149540H2	IBERCAJA/PAG 20090611	11/06/2009	C	983,44

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0514954010	IBERCAJA/PAG 20091210	10/12/2009	C	968,12
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0514954504	IBERCAJA/PAG 20090108	08/01/2009	C	989,24
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0514954512	IBERCAJA/PAG 20090115	15/01/2009	C	997,70
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0514954728	IBERCAJA/PAG 20090402	02/04/2009	C	974,23
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0514954785	IBERCAJA/PAG 20090507	07/05/2009	C	976,39
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0514954827	IBERCAJA/PAG 20090528	28/05/2009	C	980,94
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0514954843	IBERCAJA/PAG 20090604	04/06/2009	C	971,51
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0514954876	IBERCAJA/PAG 20091119	19/11/2009	C	958,70
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGC	ES0514954975	IBERCAJA/PAG 20091008	08/10/2009	C	965,09
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO CATOLIC	ES05151340A7	CAJACIRCULO/PAG 20090113	13/01/2009	C	98.724,91
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO CATOLIC	ES05151340H2	CAJACIRCULO/PAG 20090310	10/03/2009	C	98.318,27
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO CATOLIC	ES05151340L4	CAJACIRCULO/PAG 20090512	12/05/2009	C	97.706,71
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO CATOLIC	ES05151340R1	CAJACIRCULO/PAG 20090804	04/08/2009	C	97.414,69
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DEL CIRCULO CATOLIC	ES05151340S9	CAJACIRCULO/PAG 20091201	01/12/2009	C	96.776,31
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970AE5	LACAIXA/PAG 20090220	20/02/2009	C	985,23
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970AM8	LACAIXA/PAG 20090310	10/03/2009	C	988,20
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970AP1	LACAIXA/PAG 20090331	31/03/2009	C	974,72
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970AW7	LACAIXA/PAG 20090327	27/03/2009	C	974,64
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970B96	LACAIXA/PAG 20090106	06/01/2009	C	990,06
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970BG8	LACAIXA/PAG 20090407	07/04/2009	C	973,85
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970BI4	LACAIXA/PAG 20090408	08/04/2009	C	973,76
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970BL8	LACAIXA/PAG 20090105	05/01/2009	C	993,97
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970BY1	LACAIXA/PAG 20090224	24/02/2009	C	987,00
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970C79	LACAIXA/PAG 20090127	27/01/2009	C	988,26
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970CA9	LACAIXA/PAG 20090512	12/05/2009	C	972,36
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970CB7	LACAIXA/PAG 20091006	06/10/2009	C	950,18
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970CF8	LACAIXA/PAG 20090519	19/05/2009	C	967,50
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970CI2	LACAIXA/PAG 20090616	16/06/2009	C	962,95
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970CJ0	LACAIXA/PAG 20090529	29/05/2009	C	965,69
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970CM4	LACAIXA/PAG 20090602	02/06/2009	C	985,71
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970CS1	LACAIXA/PAG 20090609	09/06/2009	C	984,16
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970CZ6	LACAIXA/PAG 20090623	23/06/2009	C	985,18
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970D11	LACAIXA/PAG 20090203	03/02/2009	C	994,87
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970D37	LACAIXA/PAG 20090210	10/02/2009	C	991,76
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970DJ8	LACAIXA/PAG 20090908	08/09/2009	C	957,59
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970DM2	LACAIXA/PAG 20090211	11/02/2009	C	995,16
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970DW1	LACAIXA/PAG 20090730	30/07/2009	C	958,04
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970DY7	LACAIXA/PAG 20090130	30/01/2009	C	989,69
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970E51	LACAIXA/PAG 20090303	03/03/2009	C	989,47
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970EB3	LACAIXA/PAG 20090814	14/08/2009	C	961,27
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970EJ6	LACAIXA/PAG 20090901	01/09/2009	C	964,02
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970EK4	LACAIXA/PAG 20090903	03/09/2009	C	957,10
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970ES7	LACAIXA/PAG 20090914	14/09/2009	C	971,90
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970EW9	LACAIXA/PAG 20090924	24/09/2009	C	970,27
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970E22	LACAIXA/PAG 20090925	25/09/2009	C	952,62
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970FB2	LACAIXA/PAG 20090317	17/03/2009	C	985,39
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970F90	LACAIXA/PAG 20090928	28/09/2009	C	952,75
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970FO3	LACAIXA/PAG 20090427	27/04/2009	C	975,67
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970FR6	LACAIXA/PAG 20091030	30/10/2009	C	961,06
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970FS4	LACAIXA/PAG 20091102	02/11/2009	C	957,42
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970FU0	LACAIXA/PAG 20091103	03/11/2009	C	954,83
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970FX4	LACAIXA/PAG 20091117	17/11/2009	C	959,69
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970G42	LACAIXA/PAG 20090324	24/03/2009	C	987,65
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970GA0	LACAIXA/PAG 20090116	16/01/2009	C	997,19
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970GC6	LACAIXA/PAG 20091124	24/11/2009	C	960,28
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970GD4	LACAIXA/PAG 20090112	12/01/2009	C	997,56
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970GF9	LACAIXA/PAG 20091127	27/11/2009	C	961,35
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970GH5	LACAIXA/PAG 20091201	01/12/2009	C	963,59
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970H90	LACAIXA/PAG 20090414	14/04/2009	C	973,78
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970I32	LACAIXA/PAG 20090421	21/04/2009	C	976,27
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970K04	LACAIXA/PAG 20090428	28/04/2009	C	985,43
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970L78	LACAIXA/PAG 20090526	26/05/2009	C	981,44
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970N27	LACAIXA/PAG 20090707	07/07/2009	C	963,21
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970P82	LACAIXA/PAG 20090113	13/01/2009	C	987,07
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970P90	LACAIXA/PAG 20090811	11/08/2009	C	961,12
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970T13	LACAIXA/PAG 20091013	13/10/2009	C	954,80
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970T47	LACAIXA/PAG 20091020	20/10/2009	C	973,59
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970W91	LACAIXA/PAG 20090217	17/02/2009	C	988,99
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970Y40	LACAIXA/PAG 20090120	20/01/2009	C	993,63
CAJA DE AHORROS Y PENSIONES DE BARCELONA	ES0514970Z56	LACAIXA/PAG 20090123	23/01/2009	C	988,49
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE	ES05154744U5	CA.ESPAÑA/PAG 20090218	18/02/2009	C	9.869,19
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE	ES05154744Y7	CA.ESPAÑA/PAG 20090401	01/04/2009	C	9.792,77
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE	ES05154745E6	CA.ESPAÑA/PAG 20090424	24/04/2009	C	9.804,50
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE	ES05154745I7	CA.ESPAÑA/PAG 20090515	15/05/2009	C	9.753,83
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE	ES05154745L1	CA.ESPAÑA/PAG 20090610	10/06/2009	C	9.640,85
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE	ES05154745O5	CA.ESPAÑA/PAG 20090616	16/06/2009	C	9.727,92
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE	ES05154745U2	CA.ESPAÑA/PAG 20090708	08/07/2009	C	9.729,46
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE	ES05154745Y4	CA.ESPAÑA/PAG 20090807	07/08/2009	C	9.622,35
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE	ES05154746E4	CA.ESPAÑA/PAG 20090316	16/03/2009	C	9.824,29
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, CAJA DE AHORROS Y MONTE	ES05154746F1	CA.ESPAÑA/PAG 20090116	16/01/2009	C	9.870,86
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0515009209	CAJACANARIAS/PAG 20090109	09/01/2009	C	997,81
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0515009266	CAJACANARIAS/PAG 20090116	16/01/2009	C	987,06
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0515009498	CAJACANARIAS/PAG 20090320	20/03/2009	C	991,59
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0515009712	CAJACANARIAS/PAG 20091030	30/10/2009	C	953,32
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0515009753	CAJACANARIAS/PAG 20090206	06/02/2009	C	988,12

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
CAJA GENERAL DE AHORROS DE CANARIAS	ES0515009878	CAJACANARIAS/PAG 20090306	06/03/2009	C	992,14
CAJA GENERAL DE AHORROS DE GRANADA	ES05149823F6	CA.GRANADA/PAG 20091204	04/12/2009	C	96.676,84
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES05149834O5	LA.CAJA/PAG 20090403	03/04/2009	C	49.090,59
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES05149836Q5	LA.CAJA/PAG 20090807	07/08/2009	C	48.112,84
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES05149837F6	LA.CAJA/PAG 20090908	08/09/2009	C	47.864,58
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES05149837U5	LA.CAJA/PAG 20090929	29/09/2009	C	47.340,55
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES05149838J6	LA.CAJA/PAG 20091113	13/11/2009	C	47.791,41
CAJA INSULAR DE AHORROS DE CANARIAS	ES05149838T5	LA.CAJA/PAG 20091224	24/12/2009	C	48.366,66
CAJA LABORAL POPULAR COOP. DE CREDITO	ES0515462CJ7	CA.LABORAL/PAG 20090302	02/03/2009	C	994,28
CAJA LABORAL POPULAR COOP. DE CREDITO	ES0515462DC0	CA.LABORAL/PAG 20091118	18/11/2009	C	983,06
CAJA LABORAL POPULAR COOP. DE CREDITO	ES0515462M87	CA.LABORAL/PAG 20090318	18/03/2009	C	988,40
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153067Z1	CR.NAVARRA/PAG 20090211	11/02/2009	C	49.453,43
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153068R6	CR.NAVARRA/PAG 20090225	25/02/2009	C	49.520,31
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153068W6	CR.NAVARRA/PAG 20090429	29/04/2009	C	49.445,67
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153069H5	CR.NAVARRA/PAG 20090617	17/06/2009	C	49.190,58
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153069Q6	CR.NAVARRA/PAG 20090107	07/01/2009	C	49.324,18
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES05153069V6	CR.NAVARRA/PAG 20090128	28/01/2009	C	49.372,79
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306A16	CR.NAVARRA/PAG 20090930	30/09/2009	C	47.454,65
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306A24	CR.NAVARRA/PAG 20091007	07/10/2009	C	47.340,16
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306A65	CR.NAVARRA/PAG 20090121	21/01/2009	C	49.765,64
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306A73	CR.NAVARRA/PAG 20091028	28/10/2009	C	48.595,07
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306A81	CR.NAVARRA/PAG 20091104	04/11/2009	C	47.791,23
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306A99	CR.NAVARRA/PAG 20091111	11/11/2009	C	47.921,14
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306B07	CR.NAVARRA/PAG 20090520	20/05/2009	C	48.952,05
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306B15	CR.NAVARRA/PAG 20090527	27/05/2009	C	49.029,43
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306B23	CR.NAVARRA/PAG 20090109	09/01/2009	C	49.877,02
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306B31	CR.NAVARRA/PAG 20091209	09/12/2009	C	48.353,18
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306B49	CR.NAVARRA/PAG 20091202	02/12/2009	C	48.236,51
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306B64	CR.NAVARRA/PAG 20091216	16/12/2009	C	48.336,94
CAJA RURAL DE NAVARRA, S. COOP. DE CREDITO	ES0515306B72	CR.NAVARRA/PAG 20090218	18/02/2009	C	49.732,21
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CF	ES0515316265	RURALCAJA/PAG 20090107	07/01/2009	C	9.892,73
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CF	ES0515316273	RURALCAJA/PAG 20090114	14/01/2009	C	9.888,51
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CF	ES0515316281	RURALCAJA/PAG 20090121	21/01/2009	C	9.845,87
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CF	ES0515316455	RURALCAJA/PAG 20091007	07/10/2009	C	47.274,40
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CF	ES0515316471	RURALCAJA/PAG 20091202	02/12/2009	C	48.299,85
CAJA RURAL DEL MEDITERRANEO, RURALCAJA, S. COOP. DE CF	ES0515316489	RURALCAJA/PAG 20091209	09/12/2009	C	48.364,15
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0514601469	CAJAMAR/PAG 20090113	13/01/2009	C	993,56
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0514601568	CAJAMAR/PAG 20090401	01/04/2009	C	979,56
CAJAMAR CAJA RURAL, SOCIEDAD COOPERATIVA DE CREDITO	ES0514601626	CAJAMAR/PAG 20090527	27/05/2009	C	971,36
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309910N1	ELE.CAP/PAG 20090311	11/03/2009	C	49.551,41
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309910O9	ELE.CAP/PAG 20090325	25/03/2009	C	49.584,45
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309910V4	ELE.CAP/PAG 20090506	06/05/2009	C	48.650,34
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309910Y8	ELE.CAP/PAG 20090520	20/05/2009	C	48.970,49
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309910Z5	ELE.CAP/PAG 20090603	03/06/2009	C	49.046,48
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911C2	ELE.CAP/PAG 20090114	14/01/2009	C	49.880,46
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911E8	ELE.CAP/PAG 20090401	01/04/2009	C	49.269,68
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911F5	ELE.CAP/PAG 20090107	07/01/2009	C	49.423,41
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911G3	ELE.CAP/PAG 20090121	21/01/2009	C	49.697,27
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911H1	ELE.CAP/PAG 20090422	22/04/2009	C	48.782,56
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911I9	ELE.CAP/PAG 20090128	28/01/2009	C	49.519,87
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911J7	ELE.CAP/PAG 20090429	29/04/2009	C	48.820,06
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911K5	ELE.CAP/PAG 20090211	11/02/2009	C	49.491,42
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911L3	ELE.CAP/PAG 20090513	13/05/2009	C	48.933,41
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911M1	ELE.CAP/PAG 20091111	11/11/2009	C	47.887,87
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911N9	ELE.CAP/PAG 20090218	18/02/2009	C	49.483,38
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911O7	ELE.CAP/PAG 20091118	18/11/2009	C	47.956,03
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911P4	ELE.CAP/PAG 20090225	25/02/2009	C	49.512,81
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911Q2	ELE.CAP/PAG 20090527	27/05/2009	C	49.019,18
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911R0	ELE.CAP/PAG 20091125	25/11/2009	C	48.056,78
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911S8	ELE.CAP/PAG 20090304	04/03/2009	C	49.518,17
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911T6	ELE.CAP/PAG 20090902	02/09/2009	C	48.585,20
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911U4	ELE.CAP/PAG 20091202	02/12/2009	C	48.120,77
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911V2	ELE.CAP/PAG 20090610	10/06/2009	C	49.105,27
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911W0	ELE.CAP/PAG 20090617	17/06/2009	C	49.185,61
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911X8	ELE.CAP/PAG 20090318	18/03/2009	C	49.584,25
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911Y6	ELE.CAP/PAG 20091216	16/12/2009	C	48.342,01
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309911Z3	ELE.CAP/PAG 20090624	24/06/2009	C	49.202,47
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309912A4	ELE.CAP/PAG 20090923	23/09/2009	C	48.832,64
ENDESA CAPITAL, S.A.	ES05309912B2	ELE.CAP/PAG 20091223	23/12/2009	C	48.440,04
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060251I9	HIDROCANTABRICO/PAG 20090316	16/03/2009	C	992,67
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060251K5	HIDROCANTABRICO/PAG 20090415	15/04/2009	C	974,93
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060251N9	HIDROCANTABRICO/PAG 20090130	30/01/2009	C	986,56
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060251P4	HIDROCANTABRICO/PAG 20090513	13/05/2009	C	973,50
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060251Q2	HIDROCANTABRICO/PAG 20090216	16/02/2009	C	989,42
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060251R0	HIDROCANTABRICO/PAG 20090525	25/05/2009	C	973,69
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060251S8	HIDROCANTABRICO/PAG 20090227	27/02/2009	C	985,47
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060251T6	HIDROCANTABRICO/PAG 20090529	29/05/2009	C	980,64
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060251U4	HIDROCANTABRICO/PAG 20090615	15/06/2009	C	983,51
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060251X8	HIDROCANTABRICO/PAG 20090331	31/03/2009	C	974,20
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060251Y6	HIDROCANTABRICO/PAG 20090629	29/06/2009	C	964,68
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060252A4	HIDROCANTABRICO/PAG 20090109	09/01/2009	C	993,63
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060252B2	HIDROCANTABRICO/PAG 20090115	15/01/2009	C	987,47
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060252C0	HIDROCANTABRICO/PAG 20090714	14/07/2009	C	977,29
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060252L1	HIDROCANTABRICO/PAG 20090929	29/09/2009	C	948,86
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060252M9	HIDROCANTABRICO/PAG 20091015	15/10/2009	C	949,82

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060252N7	HIDROCANTABRICO/PAG 20091030	30/10/2009	C	953,87
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060252O5	HIDROCANTABRICO/PAG 20091116	16/11/2009	C	958,38
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060252P2	HIDROCANTABRICO/PAG 20091029	29/10/2009	C	960,14
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060252Q0	HIDROCANTABRICO/PAG 20091127	27/11/2009	C	961,92
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060252R8	HIDROCANTABRICO/PAG 20091208	08/12/2009	C	964,41
HIDROELECTRICA DEL CANTABRICO, S.A.	ES05060252S6	HIDROCANTABRICO/PAG 20091214	14/12/2009	C	966,45
IBERDROLA, S.A.	ES0544580DG5	IBE/PAG 20090108	08/01/2009	C	991,77
IBERDROLA, S.A.	ES0544580DJ1	IBE/PAG 20090115	15/01/2009	C	995,95
IBERDROLA, S.A.	ES0544580DK7	IBE/PAG 20090122	22/01/2009	C	987,56
IBERDROLA, S.A.	ES0544580DL5	IBE/PAG 20090219	19/02/2009	C	988,33
IBERDROLA, S.A.	ES0544580DM3	IBE/PAG 20090205	05/02/2009	C	987,82
IBERDROLA, S.A.	ES0544580DN1	IBE/PAG 20090226	26/02/2009	C	985,77
IBERDROLA, S.A.	ES0544580DO9	IBE/PAG 20090305	05/03/2009	C	983,36
IBERDROLA, S.A.	ES0544580DQ4	IBE/PAG 20090318	18/03/2009	C	982,63
IBERDROLA, S.A.	ES0544580DR2	IBE/PAG 20090326	26/03/2009	C	982,46
IBERDROLA, S.A.	ES0544580DT8	IBE/PAG 20090402	02/04/2009	C	976,47
IBERDROLA, S.A.	ES0544580DU6	IBE/PAG 20090409	09/04/2009	C	975,18
IBERDROLA, S.A.	ES0544580DW2	IBE/PAG 20090416	16/04/2009	C	974,26
IBERDROLA, S.A.	ES0544580DX0	IBE/PAG 20090423	23/04/2009	C	976,64
IBERDROLA, S.A.	ES0544580DY8	IBE/PAG 20090430	30/04/2009	C	974,11
IBERDROLA, S.A.	ES0544580EA6	IBE/PAG 20090507	07/05/2009	C	976,62
IBERDROLA, S.A.	ES0544580EB4	IBE/PAG 20090514	14/05/2009	C	979,24
IBERDROLA, S.A.	ES0544580EC2	IBE/PAG 20090521	21/05/2009	C	976,08
IBERDROLA, S.A.	ES0544580ED0	IBE/PAG 20090528	28/05/2009	C	976,96
IBERDROLA, S.A.	ES0544580EE8	IBE/PAG 20090604	04/06/2009	C	978,60
IBERDROLA, S.A.	ES0544580EF5	IBE/PAG 20090611	11/06/2009	C	982,68
IBERDROLA, S.A.	ES0544580EG3	IBE/PAG 20090618	18/06/2009	C	983,21
IBERDROLA, S.A.	ES0544580EJ7	IBE/PAG 20090702	02/07/2009	C	966,98
IBERDROLA, S.A.	ES0544580EK5	IBE/PAG 20090709	09/07/2009	C	960,57
IBERDROLA, S.A.	ES0544580EM1	IBE/PAG 20090716	16/07/2009	C	971,11
IBERDROLA, S.A.	ES0544580EN9	IBE/PAG 20090723	23/07/2009	C	963,82
IBERDROLA, S.A.	ES0544580EO7	IBE/PAG 20090729	29/07/2009	C	988,69
IBERDROLA, S.A.	ES0544580ER0	IBE/PAG 20090806	06/08/2009	C	956,91
IBERDROLA, S.A.	ES0544580ES8	IBE/PAG 20090812	12/02/2009	C	992,47
IBERDROLA, S.A.	ES0544580ET6	IBE/PAG 20090820	20/08/2009	C	954,07
IBERDROLA, S.A.	ES0544580EV2	IBE/PAG 20090903	03/09/2009	C	972,15
IBERDROLA, S.A.	ES0544580EW0	IBE/PAG 20090910	10/09/2009	C	953,37
IBERDROLA, S.A.	ES0544580EX8	IBE/PAG 20090917	17/09/2009	C	955,68
IBERDROLA, S.A.	ES0544580EY6	IBE/PAG 20090924	24/09/2009	C	952,40
IBERDROLA, S.A.	ES0544580EZ3	IBE/PAG 20091001	01/10/2009	C	958,97
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FA3	IBE/PAG 20091008	08/10/2009	C	947,67
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FB1	IBE/PAG 20091015	15/10/2009	C	951,02
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FC9	IBE/PAG 20091029	29/10/2009	C	952,54
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FD7	IBE/PAG 20091105	05/11/2009	C	955,27
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FE5	IBE/PAG 20091204	04/12/2009	C	955,01
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FF2	IBE/PAG 20091112	12/11/2009	C	957,85
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FH8	IBE/PAG 20091119	19/11/2009	C	964,92
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FI6	IBE/PAG 20091126	26/11/2009	C	960,89
IBERDROLA, S.A.	ES0544580FJ4	IBE/PAG 20091203	03/12/2009	C	961,88
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE CREDIT	ES05176173V9	LICO.LEASING/PAG 20090107	07/01/2009	C	99.388,15
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE CREDIT	ES05176173Z0	LICO.LEASING/PAG 20090226	26/02/2009	C	99.009,79
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE CREDIT	ES05176174A1	LICO.LEASING/PAG 20090311	11/03/2009	C	98.065,15
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE CREDIT	ES05176174D5	LICO.LEASING/PAG 20090423	23/04/2009	C	98.310,83
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE CREDIT	ES05176174J2	LICO.LEASING/PAG 20090522	22/05/2009	C	97.373,28
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE CREDIT	ES05176174T1	LICO.LEASING/PAG 20090130	30/01/2009	C	98.853,36
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE CREDIT	ES05176174Y1	LICO.LEASING/PAG 20090313	13/03/2009	C	99.248,54
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE CREDIT	ES05176174Z8	LICO.LEASING/PAG 20090914	14/09/2009	C	94.943,75
LICO LEASING, S.A., ESTABLECIMIENTO FINANCIERO DE CREDIT	ES05176175A8	LICO.LEASING/PAG 20091006	06/10/2009	C	94.681,22
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANDO DE HL	ES0558197382	CAJASOL/PAG 20090115	15/01/2009	C	49.736,95
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANDO DE HL	ES0558197473	CAJASOL/PAG 20090326	26/03/2009	C	49.110,58
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANDO DE HL	ES0558197812	CAJASOL/PAG 20090129	29/01/2009	C	991,90
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANDO DE HL	ES0558197838	CAJASOL/PAG 20090917	17/09/2009	C	964,95
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANDO DE HL	ES0558197903	CAJASOL/PAG 20091217	17/12/2009	C	967,96
MONTE DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS SAN FERNANDO DE HL	ES0558197929	CAJASOL/PAG 20090423	23/04/2009	C	990,22
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648722F6	UNICAJA/PAG 20090120	20/01/2009	C	98.893,69
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648722G4	UNICAJA/PAG 20090205	05/02/2009	C	98.475,01
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648722J8	UNICAJA/PAG 20090320	20/03/2009	C	97.624,03
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648722K6	UNICAJA/PAG 20090406	06/04/2009	C	97.352,53
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648722L4	UNICAJA/PAG 20090420	20/04/2009	C	97.232,01
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648722M2	UNICAJA/PAG 20090505	05/05/2009	C	97.833,42
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648722T7	UNICAJA/PAG 20090805	05/08/2009	C	97.128,74
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648722Z4	UNICAJA/PAG 20090220	20/02/2009	C	49.293,19
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648723C1	UNICAJA/PAG 20090605	05/06/2009	C	49.201,07
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648723N8	UNICAJA/PAG 20090505	05/05/2009	C	48.766,20
MONTES DE PIEDAD Y CAJA DE AHORROS DE RONDA, CADIZ, AL	ES05648723O6	UNICAJA/PAG 20090520	20/05/2009	C	49.097,51
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0573093M59	REE/PAG 20090130	30/01/2009	C	988,00
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0573093M67	REE/PAG 20090316	16/03/2009	C	991,25
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0573093M75	REE/PAG 20090330	30/03/2009	C	992,53
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AB0	SAN.CONS.FIN/PAG 20091218	18/12/2009	C	967,08
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AD6	SAN.CONS.FIN/PAG 20090529	29/05/2009	C	980,08
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AE4	SAN.CONS.FIN/PAG 20090612	12/06/2009	C	982,28
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AF1	SAN.CONS.FIN/PAG 20090619	19/06/2009	C	974,14
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AL9	SAN.CONS.FIN/PAG 20090130	30/01/2009	C	985,89
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AQ8	SAN.CONS.FIN/PAG 20091002	02/10/2009	C	947,72
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AS4	SAN.CONS.FIN/PAG 20090408	08/04/2009	C	973,60

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495A2T	SAN.CONS.FIN/PAG 20091009	09/10/2009	C	950,12
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AV8	SAN.CONS.FIN/PAG 20090514	14/05/2009	C	979,32
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495AW6	SAN.CONS.FIN/PAG 20090417	17/04/2009	C	973,18
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BA0	SAN.CONS.FIN/PAG 20090430	30/04/2009	C	981,01
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BD4	SAN.CONS.FIN/PAG 20091127	27/11/2009	C	959,37
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BG7	SAN.CONS.FIN/PAG 20091204	04/12/2009	C	966,99
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BH5	SAN.CONS.FIN/PAG 20091211	11/12/2009	C	968,10
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BK9	SAN.CONS.FIN/PAG 20100108	08/01/2010	C	942,83
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BM5	SAN.CONS.FIN/PAG 20100115	15/01/2010	C	938,30
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495BY0	SAN.CONS.FIN/PAG 20090918	18/09/2009	C	975,11
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CB6	SAN.CONS.FIN/PAG 20091030	30/10/2009	C	954,33
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CC4	SAN.CONS.FIN/PAG 20091106	06/11/2009	C	961,65
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495CE0	SAN.CONS.FIN/PAG 20091223	23/12/2009	C	968,51
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495V82	SAN.CONS.FIN/PAG 20090109	09/01/2009	C	995,86
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495V90	SAN.CONS.FIN/PAG 20090116	16/01/2009	C	993,68
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495W16	SAN.CONS.FIN/PAG 20090123	23/01/2009	C	994,12
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495W24	SAN.CONS.FIN/PAG 20090206	06/02/2009	C	987,83
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495W32	SAN.CONS.FIN/PAG 20090213	13/02/2009	C	990,48
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495W57	SAN.CONS.FIN/PAG 20090227	27/02/2009	C	982,59
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495W65	SAN.CONS.FIN/PAG 20090306	06/03/2009	C	986,99
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495W73	SAN.CONS.FIN/PAG 20090313	13/03/2009	C	989,90
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495W81	SAN.CONS.FIN/PAG 20090320	20/03/2009	C	981,92
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495W99	SAN.CONS.FIN/PAG 20090327	27/03/2009	C	987,37
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495X15	SAN.CONS.FIN/PAG 20090424	24/04/2009	C	976,58
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495X31	SAN.CONS.FIN/PAG 20090508	08/05/2009	C	974,53
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495X49	SAN.CONS.FIN/PAG 20090522	22/05/2009	C	977,90
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495X56	SAN.CONS.FIN/PAG 20090605	05/06/2009	C	980,66
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495X80	SAN.CONS.FIN/PAG 20090626	26/06/2009	C	961,93
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495X98	SAN.CONS.FIN/PAG 20090703	03/07/2009	C	980,91
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Y06	SAN.CONS.FIN/PAG 20090710	10/07/2009	C	967,15
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Y30	SAN.CONS.FIN/PAG 20090102	02/01/2009	C	997,45
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Y48	SAN.CONS.FIN/PAG 20090731	31/07/2009	C	962,43
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Y63	SAN.CONS.FIN/PAG 20090814	14/08/2009	C	956,56
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Y71	SAN.CONS.FIN/PAG 20090821	21/08/2009	C	957,03
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Z05	SAN.CONS.FIN/PAG 20090911	11/09/2009	C	951,47
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Z13	SAN.CONS.FIN/PAG 20090220	20/02/2009	C	989,18
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Z21	SAN.CONS.FIN/PAG 20090925	25/09/2009	C	953,33
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Z47	SAN.CONS.FIN/PAG 20091023	23/10/2009	C	956,49
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Z54	SAN.CONS.FIN/PAG 20091016	16/10/2009	C	948,88
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Z70	SAN.CONS.FIN/PAG 20090403	03/04/2009	C	975,73
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Z88	SAN.CONS.FIN/PAG 20091113	13/11/2009	C	957,25
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A.	ES0513495Z96	SAN.CONS.FIN/PAG 20091120	20/11/2009	C	959,28
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FC6	TEF/PAG 20090102	02/01/2009	C	986,98
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FD4	TEF/PAG 20090102	02/01/2009	C	99,128,14
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FE2	TEF/PAG 20090107	07/01/2009	C	99,398,78
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FF9	TEF/PAG 20090408	08/04/2009	C	97,355,12
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FH5	TEF/PAG 20090115	15/01/2009	C	987,89
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FI3	TEF/PAG 20090122	22/01/2009	C	98,737,17
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FJ1	TEF/PAG 20090423	23/04/2009	C	97,508,23
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FL7	TEF/PAG 20090130	30/01/2009	C	988,32
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FM5	TEF/PAG 20090130	30/01/2009	C	98,789,69
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FN3	TEF/PAG 20090204	04/02/2009	C	98,813,66
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FO1	TEF/PAG 20090212	12/02/2009	C	98,881,68
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FQ6	TEF/PAG 20090115	15/01/2009	C	99,332,64
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FR4	TEF/PAG 20090223	23/02/2009	C	99,005,20
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FU8	TEF/PAG 20090227	27/02/2009	C	990,27
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FV6	TEF/PAG 20090302	02/03/2009	C	99,034,59
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FW4	TEF/PAG 20090309	09/03/2009	C	99,188,80
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FX2	TEF/PAG 20090316	16/03/2009	C	991,64
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FY0	TEF/PAG 20090323	23/03/2009	C	99,221,98
TELEFONICA, S.A.	ES0578430FZ7	TEF/PAG 20090330	30/03/2009	C	992,43
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380GM5	UNF/PAG 20090706	06/07/2009	C	969,76
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HD2	UNF/PAG 20090605	05/06/2009	C	982,07
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HE0	UNF/PAG 20090625	25/06/2009	C	984,24
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HG5	UNF/PAG 20090115	15/01/2009	C	994,68
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HH3	UNF/PAG 20090105	05/01/2009	C	988,60
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HI1	UNF/PAG 20090126	26/01/2009	C	985,68
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HK7	UNF/PAG 20090205	05/02/2009	C	985,75
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HL5	UNF/PAG 20090216	16/02/2009	C	987,75
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HN1	UNF/PAG 20090225	25/02/2009	C	987,35
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HO9	UNF/PAG 20090305	05/03/2009	C	988,11
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HQ4	UNF/PAG 20090316	16/03/2009	C	991,24
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HS0	UNF/PAG 20090325	25/03/2009	C	988,98
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HU6	UNF/PAG 20090406	06/04/2009	C	974,15
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HV4	UNF/PAG 20090415	15/04/2009	C	972,95
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HW2	UNF/PAG 20090427	27/04/2009	C	975,71
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HX0	UNF/PAG 20091116	16/11/2009	C	957,71
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380HY8	UNF/PAG 20090518	18/05/2009	C	981,37
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380IA6	UNF/PAG 20090525	25/05/2009	C	980,95
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380IC2	UNF/PAG 20090615	15/06/2009	C	982,38
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380IG3	UNF/PAG 20090805	05/08/2009	C	961,34
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380II9	UNF/PAG 20090825	25/08/2009	C	966,26
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380IJ7	UNF/PAG 20090907	07/09/2009	C	955,86
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380IL3	UNF/PAG 20090925	25/09/2009	C	957,19
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380IM1	UNF/PAG 20091015	15/10/2009	C	947,87
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380IN9	UNF/PAG 20091026	26/10/2009	C	954,68
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380IO7	UNF/PAG 20100115	15/01/2010	C	956,01
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380IP4	UNF/PAG 20091204	04/12/2009	C	962,36
UNION FENOSA, S.A.	ES0581380IQ2	UNF/PAG 20091228	28/12/2009	C	966,51

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	600,08
BANCAJA EUROCAPITAL FINANCE, S.A.	KYG0727Q1156	BANCAJA.FIN/VAR NACU AMTB PPR B		V	600,02
BANESTO PREFERENTES, S.A.	ES0113772000	BTO.PREF/VAR NACU AMTB PPR I		V	24,94
BANKINTER EMISIONES, S.A.	ES0113549002	BKT.EM/VAR NACU AMTB PPR I		V	43,71
BANKINTER EMISIONES, S.A.	ES0113549028	BKT.EM/VAR NACU AMTB PPR II		V	42,79
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224001	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	100,50
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224027	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR B		V	100,54
BBVA CAPITAL FINANCE, S.A.	ES0114224043	BBVA.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR C		V	100,52
BBVA INTERNATIONAL LIMITED	KYG090001119	BBVA.INTL/VAR NACU AMTB PPR F		V	100,52
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL	KYG1280W1015	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.007,86
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL	KYG717151099	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.006,72
BPE PREFERENCE INTERNATIONAL	KYG717151172	BPE.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.007,63
BVA PREFERENTES, S.A.	ES0115006001	BVA.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	45.440,82
CAIXA CATALUNYA PREFERENTS, S.A.	KYG175431025	CA.CAT.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.004,30
CAIXA CATALUNYA PREFERENTS, S.A.	KYG175431108	CA.CAT.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.004,53
CAIXA DE MANLLEU PREFERENTS, S.A.	ES0115328009	CA.MANLLEU.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	500,99
CAIXA GALICIA PREFERENTES, S.A., SOCIEDAD UNIPERSONAL	ES0112805009	CA.GALICIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	598,40
CAIXA LAIETANA SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFERENTS, S.A.	ES0113251005	LAIETANA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	36.427,00
CAIXA LAIETANA SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFERENTS, S.A.	KYG1754W1087	LAIETANA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.005,67
CAIXA MANRESA PREFERENTS, S.A.	ES0115211007	CA.MANRESA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	100,18
CAIXA PENEDES CAPITAL, S.A. SOCIEDAD UNIPERSONAL	KYG1755N1079	CA.PENEDES.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.004,29
CAIXA PREFERENCE, S.A.	KYG175471039	CAIXA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.007,00
CAIXA PREFERENCE, S.A.	KYG175471112	CAIXA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.005,36
CAIXA TERRASSA, SOCIETAT DE PARTICIPACIONS PREFERENTS	KYG175491094	TERRASSA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.007,19
CAIXANOVA EMISIONES, S.A.	ES0169075001	CAIXANOVA.EM/VAR NACU AMTB PPR A		V	60,39
CAIXASABADELL PREFERENTS, S.A.	ES0101339002	CAIXASAB.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.006,95
CAIXASABADELL PREFERENTS, S.A.	ES0101339028	CAIXASAB.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	49.118,79
CAJA DE AHORRO PROVINCIAL DE GUADALAJARA, PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.	ES0157085004	GUADALAJAR.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	99.709,88
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE SEGOVIA	ES0114959002	CA.SEGOVIA/VAR NACU AMTB PPR		V	1.003,94
CAJA DE AHORROS Y MONTE DE PIEDAD DE ZARAGOZA, ARAGONESAS DE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.	ES0114954003	IBERCAJA/VAR NACU AMTB PPR 1*		V	46.974,26
CAJA DE AVILA PREFERENTES, S.A.	ES0122707005	CA.AVILA.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	1.003,95
CAJA ESPAÑA DE INVERSIONES, SOCIEDAD DE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.	ES0115372007	CA.ESPAÑA.PREF/VAR NACU AMTB PPR C		V	999,68
CAJA MADRID FINANCE PREFERRED	ES0115373005	CA.MAD.FIN.PREF/VAR NACU AMTB PPR I		V	95,41
CAJA RIOJA PREFERENTES, S.A.	ES0113698007	CA.RIOJA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	507,63
CAJA SAN FERNANDO PREFERENCE LIMITED	KYG1755U1195	CA.SAN.FER.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	302,39
CAJAMURCIA FINANCE, S.A.	KYG175552051	CAJAMURCIA.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	503,01
CAJAMURCIA PREFERENTES, S.A. UNIPERSONAL	ES0114818000	CAJAMURCIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	507,73
CAJASUR SOCIEDAD DE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.	KYG1755M1096	CAJASUR.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	604,26
CAM CAPITAL, S.A.	KYG1793R1020	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	604,33
CAM CAPITAL, S.A.	KYG1793R1103	CAM.CAP/VAR NACU AMTB PPR B		V	604,69
CANTABRIA CAPITAL SOCIEDAD DE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.	KYG1825G1082	CANTABRIA.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	603,20
CANTABRIA PREFERENTES, S.A. SOCIEDAD UNIPERSONAL	ES0182834004	CANTABRIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR I		V	1.004,01
CANTABRIA PREFERENTES, S.A. SOCIEDAD UNIPERSONAL	ES0182834020	CANTABRIA.PREF/VAR NACU AMTB PPR 2		V	1.003,61
CCM DE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A., SOCIEDAD UNIPERSONAL	ES0116977002	CCM.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	603,54
CCM PREFERENCE LIMITED	KYG1984E1180	CCM.PREF.LTD/VAR NACU AMTB PPR A		V	602,79
EL MONTE CAPITAL, S.A.U.	KYG3014M1024	MONTE.CAP/VAR NACU AMTB PPR A		V	502,94
EL MONTE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.	ES0128469006	EL.MONTE.PREF/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.005,05
ENDESA CAPITAL FINANCE, LLC.	USU291871080	ELE.CAP.FIN/VAR NACU AMTB PPR		V	22,96
GUIPUZCOANO CAPITAL, S.A.	ES0143561001	GUI.CAP/VAR NACU AMTB PPR I		V	99,83
LA CAJA DE CANARIAS PREFERENTES, S.A.	ES0156844005	LA.CAJA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	503,38
REPSOL INTERNATIONAL CAPITAL LIMITED	KYG7513K1379	REP.INTL.CAP/VAR NACU AMTB PPR B		V	1.005,84
REPSOL INTERNATIONAL CAPITAL LIMITED	KYG7513K1452	REP.INTL.CAP/VAR NACU AMTB PPR C		V	1.006,25
SA NOSTRA SOCIEDAD DE PARTICIPACIONES PREFERENTES, S.A.	KYG7803W1069	SA.NOSTRA.PREF/VAR NACU AMTB PPR A		V	1.006,13
SABADELL INTERNATIONAL EQUITY, LTD	KYG773751063	SAB.INTL.EQ/VAR NACU AMTB PPR A		V	503,24
SANTANDER FINANCE CAPITAL, S.A. UNIPERSONAL	ES0175179003	SAN.FIN.CAP/VAR NACU AMTB PPR I		V	25,00
SANTANDER FINANCE CAPITAL, S.A. UNIPERSONAL	ES0175179029	SAN.FIN.CAP/VAR NACU AMTB PPR II		V	25,00
SANTANDER FINANCE CAPITAL, S.A. UNIPERSONAL	ES0175179045	SAN.FIN.CAP/VAR NACU AMTB PPR III		V	25,00
SANTANDER FINANCE CAPITAL, S.A. UNIPERSONAL	ES0175179052	SAN.FIN.CAP/VAR NACU AMTB PPR IV		V	25,00
SANTANDER FINANCE CAPITAL, S.A. UNIPERSONAL	ES0175179060	SAN.FIN.CAP/VAR NACU AMTB PPR V		V	25,00
SOL MELIA FINANCE LIMITED	KYG8259W1033	SOL.FIN/VAR NACU AMTB PPR A		V	98,38
SOS CUETARA PREFERENTES, S.A.U.	ES0130124003	SOS.PREF/VAR NACU AMTB PPR		V	49.697,73
TELEFONICA FINANCE USA, L.L.C.	USU87942AA33	TEF.FIN.USA/VAR NACU AMTB PPR		V	1.005,60
UNION FENOSA FINANCIAL SERVICES USA, LLC.	USU90716AA64	UNF.FINL.USA/VAR NACU AMTB PPR		V	23,54

RENTA VARIABLE

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
ABENGOA, S.A.	ES0105200416	ABG/AC 0,25			11,79
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0111845014	ABE/AC 3,00			13,02
ACCIONA, S.A.	ES0125220311	ANA/AC 1,00			76,36
ACERINOX, S.A.	ES0132105018	ACX/AC 0,25			10,65
ACS, ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS, S.A.	ES0167050915	ACS/AC 0,50			29,27
ADOLFO DOMINGUEZ, S.A.	ES0106000013	ADZ/AC 0,60			7,50
AFIRMA GRUPO INMOBILIARIO, S.A.	ES0110944016	AFR/AC 0,20			0,51
AGRICOLA DE FRUTOS SECOS, S.A.	ES0106325014	AGROFUSE/AC 3,01			11,02
AGUAS DE VALENCIA, S.A.	ES0107250013	AGUAS.VAL/AC 3,01			140,00
AHORRO FAMILIAR, S.A.	ES0107511018	AH.FAMILIAR/AC 6,00			28,80
ALFA S.A. DE C.V.	MXP000511016	AC. ALFA S/A			18,10
ALZA REAL ESTATE, S.A.	ES0138436011	ALZA/AC 1,00			4,50
AMERICA MOVIL, S.A. DE C.V.	MXP001691213	AC. AMERICA MOVIL. S/L			24,34
AMPER, S.A.	ES0109260531	AMPI/AC 1,00			4,33
ANTENA 3 DE TELEVISION, S.A.	ES0109427734	A3TV/AC 0,75			4,46
ARACRUZ CELULOSE, S.A.	BRAR02ZACNPB3	AC. ARACRUZ CELULOSE. PREF. S/B			0,92
ARCELOR MITTAL, S.A.	LU0323134006	AC. ARCELORMITTAL			19,63
AVANZIT, S.A.	ES0172708317	AVZ/AC 0,50			0,98
AZKOYEN, S.A.	ES0112458312	AZK/AC 0,60			3,29
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA, S.A.	ES0113211835	BBVA/AC 0,49			8,96
BANCO BRADESCO, S.A.	BRBBD0CACNPR8	AC. BANCO BRADESCO -PREF.-			8,17
BANCO DE ANDALUCIA, S.A.	ES0113140133	AND/AC 0,75			36,31
BANCO DE CHILE, S.A.	CLP0939W1081	AC. BANCO DE CHILE			23,17
BANCO DE SABADELL, S.A.	ES0113860A34	SAB/AC 0,125			5,19
BANCO DE VALENCIA, S.A.	ES0113980F34	BVA/AC 0,25			7,46
BANCO ESPAÑOL DE CREDITO, S.A.	ES0113440038	BTO/AC 0,79			9,06
BANCO GUIPUZCOANO, S.A.	ES0113580C31	GUI/AC 0,25			5,93
BANCO PASTOR, S.A.	ES0113770434	PAS/AC 0,33			5,76
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0113790531	POP/AC 0,10			6,66
BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A.	ES0113790630	POP/AC 0,10			5,52
BANCO RIO DE LA PLATA, S.A.	ARBRI0010194	AC. BCO SANTANDER RIO. S/B			1,38
BANCO SANTANDER PUERTO RICO	PR8028091034	AC. SANTANDER BANCORP			7,76
BANCO SANTANDER, S.A.	ES0113900J37	SAN/AC 0,50			7,64
BANKINTER, S.A.	ES0113679I37	BKT/AC 0,30			7,71
BARON DE LEY, S.A.	ES0114297015	BDL/AC 0,60			41,09
BAYER AKTIENGESELLSCHAFT	DE0005752000	AC. BAYER			41,40
BBVA BANCO FRANCES, S.A.	ARP125991090	AC. BBVA BCO. FRANCES			0,92
BEFESA MEDIO AMBIENTE, S.A.	ES0114491014	BMA/AC 3,01			15,51
BODEGAS BILBAINAS, S.A.	ES0114930011	BODEGAS.BILB/AC 6,01			9,12
BODEGAS RIOJANAS, S.A.	ES0115002018	RIO/AC 0,75			8,32
BOLSAS Y MERCADOS ESPAÑOLES, SDAD HOLDING DE MDOS Y	ES0115056139	BME/AC 3,23			18,92
BRADESPAR	BRBRAPACNOR5	AC. BRADESPAR			9,32
BRADESPAR	BRBRAPACNPR2	AC. BRADESPAR -PREF.-			6,40
BRASKEM, S.A.	BRBRKMACNPA4	AC. BRASKEM -PREF.-			2,50
CAJA DE AHORROS DEL MEDITERRANEO	ES0114400007	CAM/CUPARTVA 2,00			5,60
CAMPOFRIO FOOD GROUP, S.A.	ES0121501318	CPF/AC 1,00			7,77
CARTERA INDUSTRIAL REA, S.A.	ES0162292017	CART.IND.REA/AC 2,30			3,72
CEMENTOS MOLINS, S.A.	ES0117360117	CEMENTOS.MOLINS/AC 0,30			10,64
CEMENTOS PORTLAND VALDERRIVAS, S.A.	ES0117390411	CPL/AC 1,50			26,96
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNOR6	AC. ELETROBRAS			8,64
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS, S.A.	BRELETACNPB7	AC. ELETROBRAS. PREF. S/B			7,88
CIE AUTOMOTIVE, S.A.	ES0105630315	CIE/AC 0,25			3,61
CINTRA CONCESIONES DE INFRAESTRUCTURAS DE TRANSPOR	ES0118900010	CIN/AC 0,20			6,53
CIRCULO DE VALORES MOBILIARIOS, S.A.	ES0118935016	CIRCULO.VAL.MOB/AC 6,02			6,11
CLINICA BAVIERA, S.A.	ES0119037010	CBAV/AC 0,10			6,66
CODERE, S.A.	ES0119256115	CDR/AC 0,20			9,29
COMPANHIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	BRCMIGACNPR3	AC. CEMIG -PREF.-			11,51
COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA	BRCPLEACNPB9	AC. COPEL -PREF.-			8,34
COMPANIA D'AIGÜES DE SABADELL, S.A.	ES0107350011	AGUAS.SAB/AC B 12,02			44,10
COMPANIA DE INVERSIONES Cinsa, S.A.	ES0155580014	CINSA/AC 6,01			9,70
COMPANIA DE INVERSIONES MOBILIARIAS BARCINO, S.A.	ES0155972237	INV.MOB.BARCINO/AC 1,00			0,90
COMPANIA ESPAÑOLA DE PETROLEOS, S.A.	ES0132580319	CEP/AC 1,00			68,62
COMPANIA ESPAÑOLA DE VIVIENDAS EN ALQUILER, S.A.	ES0132955016	CEVASA/AC 6,00			194,86
COMPANIA ESPAÑOLA PARA LA FABRICACION MECANICA DEL V	ES0132110018	CELO/AC 6,65			5,45
COMPANIA LEVANTINA DE EDIFICACION Y OBRAS PUBLICAS, S.A	ES0158300410	CLEO/AC 1,00			9,07
COMPANIA LOGISTICA DE HIDROCARBUROS CLH, S.A.	ES0110480219	CLH/AC D 1,20			41,46
COMPANIA VINICOLA DEL NORTE DE ESPAÑA, S.A.	ES0184140210	CUN/AC 0,24			16,33
CONSTRUCCIONES Y AUXILIAR DE FERROCARRILES, S.A	ES0121975017	CAF/AC 3,01			221,32
CORPORACION DERMOESTETICA, S.A.	ES0124204019	DERM/AC 0,10			3,58
CORPORACION FINANCIERA ALBA, S.A.	ES0117160111	ALB/AC 1,00			24,69
CORPORACION GEO, S.A. DE C.V.	MXP3142C1177	AC. GEO. S/B			0,90
CRITERIA CAIXACORP, S.A.	ES0140609019	CRI/AC 1,00			2,69
DESARROLLOS ESPECIALES DE SISTEMAS DE ANCLAJES, S.A.	ES0126251018	DESA/AC 0,50			12,49
DINAMIA CAPITAL PRIVADO, S.A., SCR	ES0126501131	DIN/AC 3,00			10,35
DISTRIBUCION Y SERVICIOS D&S, S.A.	CL0000000522	AC. DISTRIBUCION Y SERVICIO			13,78
DOGÍ INTERNATIONAL FABRICS, S.A.	ES0126962010	DGI/AC 0,60			0,66
DURO FELGUERA, S.A.	ES0162600417	MDF/AC 0,50			4,23
EBRO PULEVA, S.A.	ES0112501012	EVA/AC 0,60			10,28
ELECNOR, S.A.	ES0129743318	ENO/AC 0,10			9,05
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD, S.A.	CLP3710M1090	AC. ENDESA CHILE			27,14
ENAGAS, S.A.	ES0130960018	ENG/AC 1,50			14,12
ENDESA, S.A.	ES0130670112	ELE/AC 1,20			24,33
ENERSIS, S.A.	CLP371861061	AC. ENERSIS			10,25
ERCROS, S.A.	ES0125140014	ECR/AC 0,36			0,17
ESPAÑOLA DEL ZINC, S.A.	ES0132970213	ZNC/AC 1,00			0,88

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE AND SPACE COMPANY EAD	NL0000235190	AC. EADS			11,72
EXIDE TECHNOLOGIES, S.A.	ES0131600019	TUD/AC 3,01			6,90
FAES FARMA, S.A.	ES0134950F36	FAE/AC 0,10			4,07
FEDERICO PATERNINA, S.A.	ES0114989017	PAT/AC 6,01			6,28
FERSA ENERGIAS RENOVABLES, S.A.	ES0136463017	FRS/AC 1,00			2,43
FINANZAS E INVERSIONES VALENCIANAS, S.A.	ES0138152113	F&I.VALENCIANAS/AC 1,00			119,00
FLUIDRA, S.A.	ES0137650018	FDR/AC 1,00			2,88
FOMENTO DE CONSTRUCCIONES Y CONTRATAS, S.A.	ES0122060314	FCC/AC 1,00			28,23
FUNESPAÑA, S.A.	ES0140441017	FUN/AC 0,30			5,22
GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA, S.A.	ES0143416115	GAM/AC 0,17			14,46
GAS NATURAL SDG, S.A.	ES0116870314	GAS/AC 1,00			22,35
GENERAL DE ALQUILER DE MAQUINARIA, S.A.	ES0141571119	GALQ/AC 1,00			5,84
GERDAU, S.A.	BRGGBRACNPR8	AC. GERDAU -PREF.-			4,87
GESTEVISION TELECINCO, S.A.	ES0152503035	TL5/AC 0,50			6,84
GRIFOLS, S.A.	ES0171996012	GRF/AC 0,50			14,14
GRUPO CATALANA OCCIDENTE, S.A.	ES0116920333	GCO/AC 0,30			13,40
GRUPO ELEKTRA, S.A. DE C.V.	MX01EL000003	AC. GRUPO ELEKTRA			24,56
GRUPO EMPRESARIAL ENCE, S.A.	ES0130625512	ENC/AC 0,90			3,30
GRUPO FERROVIAL, S.A.	ES0162601019	FER/AC 1,00			22,96
GRUPO IUSACELL, S.A. DE C.V.	MX01CE080006	AC. IUSACELL			2,17
GRUPO MODELO, S.A. DE C.V.	MXP4833F1044	AC. GRUPO MODELO. S/C			22,82
IBERDROLA RENOVABLES, S.A.	ES0147645016	IBR/AC 0,50			2,61
IBERDROLA, S.A.	ES0144580Y14	IBE/AC 0,75			5,86
IBERIA LINEAS AEREAS DE ESPAÑA, S.A.	ES0147200036	IBLA/AC 0,78			1,75
IBERPAPEL GESTION, S.A.	ES0147561015	IBG/AC 0,60			11,41
INBESOS, S.A.	ES0150480111	BES/AC 1,20			3,72
INDO INTERNACIONAL, S.A.	ES0148224118	IDO/AC 1,00			1,36
INDRA SISTEMAS, S.A.	ES0118594417	IDR/AC A 0,20			15,70
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL, S.A.	ES0148396015	ITX/AC 0,15			27,53
INDUSTRIAS DEL ACETATO DE CELULOSA, S.A.	ES0150160010	INACSA/AC 5,00			5,00
INMOBILIARIA COLONIAL, S.A.	ES0139140018	COL/AC 0,12			0,17
INMOBILIARIA DEL SUR, S.A.	ES0154653911	ISUR/AC 2,00			22,07
INMOFIBAN, S.A.	ES0154936035	INMOFIBAN/AC 1,53			91,95
INMOLEVANTE, S.A.	ES0154949012	INMOLEVANTE/AC 3,00			16,38
INVERFIATC, S.A.	ES0143419317	INVERFIATC/AC 1,00			0,82
INVERPYME, SCR, S.A.	ES0155151014	INVERPYME/AC 1,00			1,23
INYPISA INFORMES Y PROYECTOS, S.A.	ES0152768612	INY/AC 0,50			2,88
ITINERE INFRAESTRUCTURAS, S.A.	ES0133848012	ITI/AC 0,49			3,67
JAZZTEL, PLC.	GB00057933615	AC. JAZZTEL			0,16
JOAQUIM ALBERTI, S.A.	ES0156528012	JOAQUIN.ALBERTI/AC 300,51			307,76
LA SEDA DE BARCELONA, S.A.	ES0175290115	SED/AC 1,00			0,43
LABORATORIOS ALMIRALL, S.A.	ES0157097017	ALM/AC 0,12			6,44
LABORATORIOS FARMACEUTICOS ROVI, S.A.	ES0157261019	ROVI/AC 0,06			6,42
LIBERTAS 7, S.A.	ES0137998A12	LIBERTAS.7/AC 0,50			15,50
LINGOTES ESPECIALES, S.A.	ES0158480311	LGT/AC 1,00			3,79
LIWE ESPAÑOLA, S.A.	ES0158545030	LIWE.ESPAÑOLA/AC 3,15			9,70
MAPFRE, S.A.	ES0124244E34	MAP/AC 0,10			2,51
MECALUX, S.A.	ES0161928116	MLX/AC 1,00			13,91
METROVACESA, S.A.	ES0154220414	MVC/AC 1,50			50,11
MIQUEL Y COSTAS & MIQUEL, S.A.	ES0164180012	MCM/AC 2,00			10,06
MOBILIARIA MONESA, S.A.	ES0164228019	MOB.MONESA/AC 3,01			21,85
MONTEBALITO, S.A.	ES0116494016	MTB/AC 1,00			4,86
NATRA, S.A.	ES0165515117	NAT/AC 1,20			4,82
NATRACEUTICAL, S.A.	ES0165359011	NTC/AC 0,10			0,57
NET SERVIÇOS DE COMUNICAÇÃO, S.A.	BRNETCACNPR3	AC. NET SERVIÇOS DE COMUNICAÇÃO -PR			4,52
NH HOTELES, S.A.	ES0161560018	NHH/AC 2,00			5,62
NICOLAS CORREA, S.A.	ES0166300212	NEA/AC 0,80			4,26
OBRAŞCON HUARTE LAİN, S.A.	ES0142090317	OHL/AC 0,60			9,44
PAPELES Y CARTONES DE EUROPA, S.A.	ES0168561019	PAC/AC 2,00			3,55
PARQUESOL INMOBILIARIA Y PROYECTOS, S.A.	ES0168632018	PSL/AC 1,00			9,36
PESCANOVA, S.A.	ES0169350016	PVA/AC 6,00			27,47
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNOR9	AC. PETROBRAS			9,28
PETROLEO BRASILEIRO, S.A.	BRPETRACNPR6	AC. PETROBRAS -PREF.-			7,66
PRIM, S.A.	ES0170884417	PRM/AC 0,25			6,22
PROMOTORA DE INFORMACIONES, S.A.	ES0171743117	PRS/AC A 0,10			3,02
PROSEGUR, COMPAÑIA DE SEGURIDAD, S.A.	ES0175438235	PSG/AC 0,60			22,31
PULEVA BIOTECH, S.A.	ES0172233118	BIO/AC 0,24			1,19
REALIA BUSINESS, S.A.	ES0173908015	RLIA/AC 0,24			1,95
RED ELECTRICA CORPORACION, S.A.	ES0173093115	REE/AC 2,00			33,27
RENO DE MEDICI, S.P.A.	IT0001178299	AC. RENO DE MEDICI. S/A			0,19
RENTA 4 SERVICIOS DE INVERSION, S.A.	ES0173358039	R4/AC 0,40			6,50
RENTA CORPORACION REAL ESTATE, S.A.	ES0173365018	REN/AC 1,00			3,14
REPSOL YPF, S.A.	ES0173516115	REP/AC 1,00			15,56
REYAL URBIS, S.A.	ES0122761010	REY/AC 0,01			6,12
S.A. RONSA	ES0174300014	RONSA/AC 60,10			49,00
SACYR VALLEHERMOSO, S.A.	ES0182870214	SYV/AC 1,00			8,04
SADIA, S.A.	BRSDIAACNPR1	AC. SADIA -PREF.-			1,40
SARE HOLDING, S.A., DE C.V.	MX01SA030007	AC. SARE. S/B			1,75
SERVICE POINT SOLUTIONS, S.A.	ES0143421G11	SPS/AC 0,60			0,86
SNIACE, S.A.	ES0165380017	SNC/AC 0,10			0,97
SOCIEDAD ANONIMA DAMM	ES0125690513	DAMM/AC 0,20			7,47
SOCIEDAD ANONIMA HULLERA VASCO-LEONESA	ES0146940012	HULLERA.VAS-LE/AC 3,01			5,47
SOCIEDAD GENERAL DE AGUAS DE BARCELONA, S.A.	ES0141330C19	AGS/AC 1,00			14,81
SOL MELIA, S.A.	ES0176252718	SOL/AC 0,20			4,28
SOLARIA ENERGIA Y MEDIOAMBIENTE, S.A.	ES0165386014	SLR/AC 0,01			2,52

Nombre del emisor	ISIN	Nombre del Valor	Fecha Vencimiento	Cupón (**)	Valor Medio Euros
SOS CUETARA, S.A.	ES0110047919	SOS/AC 1,50			11,36
SOTOGRADE, S.A.	ES0138109014	STG/AC 0,60			8,82
TAVEX ALGODONERA, S.A.	ES0108180219	ASA/AC 0,92			0,67
TECNICAS REUNIDAS, S.A.	ES0178165017	TRE/AC 0,10			20,03
TECNOCOM, TELECOMUNICACIONES Y ENERGIA, S.A.	ES0147582B12	TEC/AC 0,50			3,13
TELEFONICA, S.A.	ES0178430E18	TEF/AC 1,00			15,35
TELEFONOS DE MEXICO, S.A.	MXP904131325	AC. TELMEX. S/L			14,69
TELMEX INTERNACIONAL, S.A.B. DE C.V.	MX01TE090014	AC. TELMEX INT S/L			7,75
TESTA INMUEBLES EN RENTA, S.A.	ES0170885018	TST/AC 6,00			15,94
TUBACEX, S.A.	ES0132945017	TUB/AC 0,45			2,80
TUBOS REUNIDOS, S.A.	ES0180850416	TRG/AC 0,10			2,39
TV AZTECA, S.A. DE C.V.	MXP740471117	AC. TV AZTECA			3,46
UNION CATALANA DE VALORES, S.A.	ES0181222011	UNION.CAT.VAL/AC 30,05			36,00
UNION EUROPEA DE INVERSIONES, S.A.	ES0181480114	U.EUROPEA.INV/AC 1,00			16,72
UNION FENOSA, S.A.	ES0181380710	UNF/AC 1,00			17,10
UNIPAPEL, S.A.	ES0182045312	UPL/AC 1,50			10,29
URALITA, S.A.	ES0182170615	URA/AC 0,72			4,52
URBAR INGENIEROS, S.A.	ES0182484214	URBAR.ING/AC 0,50			3,73
URBAS GUADAHERMOSA, S.A.	ES0182280018	URBAS/AC 0,64			0,17
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNOR3	AC. USIMINAS			8,16
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS, S.A.	BRUSIMACNPA6	AC. USIMINAS -PREF-			8,84
VALE DO RIO DOCE,COMPANHIA	BRVALEACNORO	AC. VALE DO RIO DOCE			9,24
VALE DO RIO DOCE,COMPANHIA	BRVALEACNPA3	AC. VALE DO RIO DOCE. PREF. 6%			8,33
VERTICE TRESCIENTOS SESENTA GRADOS, S.A.	ES0183304312	VER/AC 0,50			0,73
VIDRALA, S.A.	ES0183746314	VID/AC 1,02			15,71
VISCOFAN, S.A.	ES0184262212	VIS/AC 0,30			13,81
VOCENTO, S.A.	ES0114820113	VOC/AC 0,20			4,45
VOLCAN COMPAÑIA MINERA, S.A.A.	PEP648014202	AC. VOLCAN. PREF. S/B			3,49
VUELING AIRLINES, S.A.	ES0184591032	VLG/AC 1,00			3,78
ZARDOYA OTIS, S.A.	ES0184933812	ZOT/AC 0,10			13,83
ZELTIA, S.A.	ES0184940817	ZEL/AC 0,05			3,76